

УТВЕРЖДЕНЫ

решением Наблюдательного совета
ЗАО АКБ «Национальный Клиринговый Центр»

от 22 октября 2012 года (Протокол № 7)

Председатель Наблюдательного совета
ЗАО АКБ «Национальный Клиринговый Центр»



Лыков С.П.

**ПРАВИЛА ОСУЩЕСТВЛЕНИЯ КЛИРИНГОВОЙ ДЕЯТЕЛЬНОСТИ
АКЦИОНЕРНЫМ КОММЕРЧЕСКИМ БАНКОМ «НАЦИОНАЛЬНЫЙ
КЛИРИНГОВЫЙ ЦЕНТР» (ЗАКРЫТОЕ АКЦИОНЕРНОЕ ОБЩЕСТВО)
ПРИ ПРОВЕДЕНИИ ЕДИНОЙ ТОРГОВОЙ СЕССИИ**

Москва, 2012г.

СОДЕРЖАНИЕ

1. Термины и определения	5
2. Общие положения	11
3. Договор об оказании клиринговых услуг	16
4. Требования к Участникам клиринга	17
5. Условия клирингового обслуживания. Порядок предоставления допуска к клиринговому обслуживанию	18
6. Порядок регистрации Участников клиринга и их Клиентов	22
7. Порядок приостановления и прекращения допуска к клиринговому обслуживанию	24
8. Порядок урегулирования неисполненных обязательств в случае прекращения допуска к клиринговому обслуживанию	27
9. Конфиденциальность и персональные данные	35
10. Порядок использования Аналога собственноручной подписи	36
11. Клиринговые регистры	37
12. Единый лимит и риск-параметры	38
13. Порядок взаимодействия с Администратором при подаче заявок и заключении Сделок	43
14. Порядок проведения клиринговых сессий	47
15. Порядок внесения и возврата Обеспечения	49
16. Порядок внесения и возврата взноса в Фонд	53
17. Порядок исполнения / прекращения обязательств по Сделкам и обязательств по возврату Компенсационных взносов	54
18. Порядок взимания комиссионных вознаграждений	61
19. Порядок урегулирования случаев неисполнения или ненадлежащего исполнения Участниками клиринга обязательств по Сделкам и Маржинальных требований	66
20. Порядок использования и возмещения Фонда	75
21. Взаимодействие с Администратором при возникновении обстоятельств, которые могут повлиять на возможность проведения торгов	77
22. Чрезвычайные ситуации	77
23. Порядок разрешения споров	79
Приложение № 1	80
Приложение № 2	81

Приложение № 3	84
Приложение № 4	85
Приложение № 5	86
Приложение № 6	87
Приложение № 7	91
Приложение № 8	92
Приложение № 9	93
Приложение № 10	95
Приложение № 11	96
Приложение № 12	97
Приложение № 13	98
Приложение № 14	99
Приложение № 15	100
Приложение № 16	101
Приложение № 17	102
Приложение № 18	103
Приложение № 19	104
Приложение № 20	105
Приложение № 21	106
Приложение № 22	107
Приложение № 23	108
Приложение № 24	109
Приложение № 25	110
Приложение № 26	113
Приложение № 27	116
Приложение № 28	118
Приложение № 29	120
Приложение № 30	122
Приложение № 31	123

Приложение № 32	124
Приложение № 33	125
Приложение № 34	126
Приложение № 35	128
Приложение № 36	129
Приложение № 37	130
Приложение № 38	131
Приложение № 39	133
Приложение № 40	134
Приложение № 41	135
Приложение № 42	139
Приложение № 43	145

1. Термины и определения

В целях настоящих Правил осуществления клиринговой деятельности Акционерным Коммерческим Банком «Национальный Клиринговый Центр» (Закрытое акционерное общество) при проведении Единой торговой сессии (далее – Правила клиринга) применяются следующие термины и определения:

Администратор Торговой системы ЕТС (Администратор) -	валютная биржа, в том смысле, в каком она понимается в Федеральном законе «О валютном регулировании и валютном контроле», уполномоченная Банком России на выполнение специальных функций, определенных Правилами ЕТС. Администратором является Открытое акционерное общество «Московская Биржа ММВБ-РТС».
Аналог собственноручной подписи / АСП –	реквизит электронного сообщения, направляемого с использованием Клиринговой системы, подтверждающий идентификацию направившего электронное сообщение лица, целостность и неизменность электронных сообщений за счет использования специализированных программно-технических средств и организационных мероприятий. Аналогом собственноручной подписи признается Клиринговый идентификатор, позволяющий однозначно идентифицировать Участника клиринга или Клиринговый центр, направивший электронное сообщение и достоверно установить, что электронное сообщение исходит от Участника клиринга или Клирингового центра, которому присвоен данный Клиринговый идентификатор.
Аутентификация -	процедура подтверждения принадлежности АСП Участнику клиринга / Клиринговому центру.
Банк – нерезидент Российской Федерации (Банк-нерезидент) -	юридическое лицо, являющееся резидентом государства - стороны Соглашения о сотрудничестве в области организации интегрированного валютного рынка государств-членов Евразийского экономического сообщества, заключенного 25 января 2006 г. в Санкт-Петербурге, Российская Федерация (далее – Международное соглашение), которое на основании специального разрешения (лицензии или иного основания) компетентного органа Стороны Международного соглашения имеет право осуществлять банковские и валютные операции, предусмотренные национальным законодательством государства учреждения Банка - нерезидента, и которое в силу Международного соглашения имеет право на проведение межбанковских конверсионных операций на территории Российской Федерации.
Биржевое свидетельство –	документ, предоставляемый Клиринговым центром Участнику клиринга по итогам Торговых сессий ЕТС или по итогам Торговых и Дополнительной сессии ЕТС, содержащий информацию об Итоговых нетто-обязательствах и/или Итоговых нетто-требованиях, Итоговых обязательствах и/или Итоговых требованиях Участника клиринга, обязательстве / требовании

	Участника клиринга по возврату Компенсационных взносов.
Верхняя (Нижняя) граница диапазона оценки рисков -	максимальное (минимальное) значение курса сделок по покупке и продаже иностранной валюты, используемое Клиринговым центром для оценки рыночных рисков по Сделкам с частичным обеспечением.
Верхняя (Нижняя) граница ценового коридора -	значение, выше (ниже) которого не может быть цена заявок, подаваемых Участниками клиринга в ходе торгов.
Государственная корпорация -	государственная корпорация, которая в соответствии с действующим законодательством Российской Федерации имеет право осуществлять банковские операции на территории Российской Федерации, включая куплю-продажу иностранной валюты.
Дата исполнения -	дата, в которую обязательства по Сделке должны быть исполнены в соответствии с условиями Сделки.
Добросовестный участник клиринга -	Участник клиринга, надлежащим образом исполнивший свои Итоговые нетто-обязательства в иностранной валюте и/или Итоговое обязательство в российских рублях перед Клиринговым центром.
Договор об оказании клиринговых услуг -	договор, предусматривающий предоставление Клиринговым центром Участнику клиринга услуг по осуществлению клиринга, а также иных услуг, связанных с осуществлением клиринга, в отношении Сделок, заключенных в ходе Единой торговой сессии (далее – клиринговое обслуживание). Договором об оказании клиринговых услуг также являются Договор на клиринговое обслуживание с правом участия в Фонде и Договор на клиринговое обслуживание без права участия в Фонде.
Договор о взаимодействии -	«Договор о взаимодействии при проведении торговых и дополнительных сессий Единой торговой сессии», заключенный между Банком России, Администратором и Клиринговым центром.
Дополнительное обеспечение -	величина в российских рублях, на которую уменьшается Единый лимит Участника клиринга, равная возможной сумме издержек Участника клиринга при неисполнении им своих Итоговых обязательств и заключении между таким Участником клиринга и Клиринговым центром сделок своп в ходе Дополнительной сессии ЕТС второго типа.
Единый лимит -	величина, рассчитываемая Клиринговым центром в российских рублях для каждого Участника клиринга, ограничивающая риски по Сделкам с частичным обеспечением, заключаемым Клиринговым центром с Участником клиринга, для которого рассчитан Единый лимит.
Задолженность -	Задолженность по комиссиям и/или Задолженность по сделкам и/или Задолженность по компенсационным взносам.
Задолженность по	неисполненное обязательство (неисполненная часть

комиссиям -	обязательства) Участника клиринга в российских рублях по уплате комиссионных вознаграждений.
Задолженность по компенсационным взносам -	неисполненное обязательство (неисполненная часть обязательства) Участника клиринга в российских рублях по уплате Компенсационных взносов.
Задолженность по сделкам -	Итоговое обязательство в российских рублях, не прекращенное после проведения зачета по итогам Дополнительной сессии ЕТС второго типа в порядке, определенном Правилами клиринга.
Индикативные курсы сделок своп -	курсы сделок своп, определяемые в соответствии с Методикой определения риск-параметров валютного рынка и используемые для корректировки Единого лимита и Торгового лимита Участников клиринга и для определения обязательств по уплате Компенсационных взносов для обязательств по Сделкам, Дата исполнения которых отстоит от текущей даты более, чем на 1 (один) Расчетный день.
Итоговое нетто-обязательство Участника клиринга -	денежные обязательства в соответствующей валюте Участника клиринга перед Клиринговым центром по Сделкам, обязательства по которым не прекращены в результате зачета в ходе клиринга в соответствии с Правилами клиринга.
Итоговое нетто-требование Участника клиринга -	денежные требования в соответствующей валюте Участника клиринга к Клиринговому центру по Сделкам, обязательства по которым не прекращены в результате зачета в ходе клиринга в соответствии с Правилами клиринга.
Итоговое обязательство Участника клиринга -	денежное обязательство в российских рублях Участника клиринга перед Клиринговым центром, равное сумме Итогового нетто-обязательства / Итогового нетто-требования Участника клиринга в российских рублях, обязательства / требования Участника клиринга по возврату Компенсационных взносов.
Итоговое требование Участника клиринга -	денежное требование в российских рублях Участника клиринга к Клиринговому центру, равное сумме Итогового нетто-обязательства / Итогового нетто-требования Участника клиринга в российских рублях, обязательства / требования Участника клиринга по возврату Компенсационных взносов.
Клиент Участника клиринга -	юридическое или физическое лицо, зарегистрированное Клиринговым центром в качестве клиента Участника клиринга. Клиентом Участника клиринга может быть как клиент Участника клиринга, так и клиент клиента Участника клиринга.
Клиринг -	определение подлежащих исполнению обязательств по Сделкам, в том числе в результате зачета встречных однородных обязательств и требований, а также деятельность, направленная на снижение рисков Участников клиринга, связанных с заключением Сделок и исполнением (прекращением) обязательств по заключенным Сделкам.
Клиринговая система -	подсистема программно-технического комплекса Технического центра, представляющая собой комплекс программно-технических средств, баз данных, телекоммуникационных

	средств, иного оборудования и программного обеспечения, с использованием которой обеспечивается осуществление Клиринговым центром клиринга.
Клиринговый идентификатор -	условное обозначение, однозначно определяющее Участника клиринга / Клиринговый центр.
Клиринговый центр -	Акционерный Коммерческий Банк «Национальный Клиринговый Центр» (Закрытое акционерное общество), являющийся кредитной организацией по законодательству Российской Федерации (лицензия Банка России на осуществление банковских операций со средствами в рублях и иностранной валюте № 3466 от 16 августа 2006 года) (далее – ЗАО АКБ «Национальный Клиринговый Центр»), заключивший с Администратором договор, предусматривающий осуществление клиринга и иных функций, связанных с осуществлением клиринга по сделкам, заключенным на ЕТС, и выполняющий функции Уполномоченной кредитной организации (УКО), определенные Правилами ЕТС.
Компенсационный взнос -	переменная часть обеспечения Участника клиринга или Клирингового центра, рассчитываемая в порядке, предусмотренном Правилами клиринга и являющаяся обеспечением исполнения обязательств по Сделкам, заключенным между данным Участником клиринга и Клиринговым центром.
Лимит, обеспеченный средствами фонда -	величина в российских рублях, на которую увеличивается Единый лимит Участника клиринга, являющегося участником Фонда, рассчитываемая в соответствии с Методикой лимитирования операций на валютном рынке.
Маржинальное требование -	требование Клирингового центра к Участнику клиринга об обеспечении обязательств по Сделкам, заключенным Клиринговым центром с Участником клиринга, предъявляемое в порядке и случае, определенных Правилами клиринга.
Международная организация -	юридическое лицо, учрежденное в соответствии с международным договором Российской Федерации и имеющее право осуществлять банковские операции, в том числе валютные операции, на территории Российской Федерации в соответствии с международными договорами Российской Федерации и законодательством Российской Федерации.
Методика лимитирования операций на валютном рынке -	внутренний документ Клирингового центра, устанавливающий порядок определения Лимитов, обеспеченных средствами фонда, для Участников клиринга, являющихся участниками Фонда, и Торговых лимитов Участников клиринга, устанавливаемых на основании решения Клирингового центра.
Методика определения риск-параметров валютного рынка -	внутренний документ Клирингового центра, устанавливающий порядок определения риск-параметров валютного рынка ОАО Московская Биржа и параметров цены сделок своп, заключаемых в ходе Дополнительных сессий ЕТС второго типа.
Недобросовестный	Участник клиринга, не исполнивший или ненадлежащим

участник клиринга -	образом исполнивший свои Итоговые нетто-обязательства в иностранной валюте и/или Итоговое обязательство в российских рублях и/или Маржинальное требование и/или имеющий Задолженность перед Клиринговым центром.
Нетто-обязательство Участника клиринга -	сумма денежных средств в соответствующей валюте, представляющая собой превышение обязательств Участника клиринга по Сделкам над его требованиями к Клиринговому центру по Сделкам в данной валюте, определяемая по каждой Дате исполнения.
Нетто-требование Участника клиринга -	сумма денежных средств в соответствующей валюте, представляющая собой превышение требований Участника клиринга по Сделкам над его обязательствами перед Клиринговым центром по Сделкам в данной валюте, определяемая по каждой Дате исполнения.
Обеспечение -	сумма денежных средств Участника клиринга в соответствующей валюте, которые используются для обеспечения исполнения обязательств Участника клиринга по Сделкам, исполнения обязательств Участника клиринга по уплате комиссионных вознаграждений. Обеспечение может использоваться для исполнения обязательств Участника клиринга по Сделкам.
Ответственный сотрудник Участника клиринга -	сотрудник Участника клиринга, на основании доверенности уполномоченный на получение и передачу информации и отчетных документов, формируемых Клиринговым центром и Участником клиринга согласно Правилам клиринга.
Пароль -	уникальная последовательность случайных чисел, используемая для аутентификации Участника клиринга или Клирингового центра.
Подсистема ЭДО НКЦ -	Подсистема Системы Электронного Документооборота ОАО ММВБ-РТС (далее – СЭД ОАО ММВБ-РТС), организатором которой является Клиринговый центр и которая используется Клиринговым центром для взаимодействия с участниками Подсистемы ЭДО НКЦ и Организатором СЭД. Подсистема ЭДО НКЦ представляет собой совокупность программного, информационного и аппаратного обеспечения Клирингового центра, Организатора СЭД и участников Подсистемы ЭДО НКЦ.
Порядок предоставления информации и отчетности -	внутренний документ Клирингового центра, устанавливающий состав, сроки и форматы предоставления информации и отчетности Участниками клиринга Клиринговому центру.
Правила ЕТС -	Правила проведения операций по покупке и продаже иностранной валюты на Единой торговой сессии, утвержденные уполномоченным органом Администратора и согласованные с Банком России.
Рабочий день -	день, в том числе выходной или праздничный нерабочий день, в который Администратор проводит торги иностранными валютами на ЕТС.
Расчетные центры -	небанковские кредитные организации, выполняющие функции

	Расчетного центра Организованного рынка ценных бумаг и других финансовых активов (ОРЦБ) в соответствии с заключенными между небанковскими кредитными организациями и Банком России договорами, а также Банк России. В Расчетных центрах Клиринговому центру открываются банковские счета.
Расчетный банк -	кредитная организация или иностранный банк, в которой(ом) открыт банковский (корреспондентский) счет Клиринговому центру в иностранной валюте, предназначенный для исполнения обязательств Участников клиринга по Сделкам и/или для учета средств Фонда.
Расчетный день -	день, который одновременно является Рабочим днем, а также рабочим днем в стране местонахождения Расчетного банка и днем, включая выходной и праздничный нерабочий день по законодательству Российской Федерации, в который Расчетный центр осуществляет расчеты.
Сайт Клирингового центра -	сайт в сети Интернет по адресу www.nkcbank.ru .
Сделка -	сделка по покупке и продаже иностранной валюты, в том числе сделка своп, заключенная на ЕТС.
Сделка с полным обеспечением -	сделка по покупке и продаже иностранной валюты, заключенная на ЕТС, условием заключения которой является наличие Обеспечения Участника клиринга в размере, необходимом для исполнения обязательств по Сделке в полном объеме.
Сделка с частичным обеспечением -	сделка по покупке и продаже иностранной валюты, в том числе сделка своп, заключенная на ЕТС, условием заключения которой является достаточность Единого лимита Участника клиринга.
Система «Клиент-КлирингБанк» -	автоматизированная система дистанционного банковского и клирингового обслуживания, предназначенная для осуществления электронного документооборота между Участниками клиринга и Клиринговым центром.
Счет для возврата денежных средств -	зарегистрированный в Клиринговом центре счет в соответствующей валюте, открытый в банке на территории Российской Федерации или в банке за пределами территории Российской Федерации, и предназначенный для перечисления на него денежных средств с целью исполнения обязательств Клирингового центра по возврату денежных средств Участнику клиринга.
Технический центр -	Открытое акционерное общество «Московская Биржа ММВБ-РТС», обеспечивающее Участникам клиринга технический доступ к Клиринговой системе на основании соответствующего договора.
Торговый лимит -	величина (в российских рублях), ограничивающая сумму денежных средств Участника клиринга, учитываемых при расчете Единого лимита Участника клиринга; устанавливается на основании запроса Участника клиринга или на основании

	решения Клирингового центра в случаях и порядке, определенных Правилами клиринга.
Уполномоченный участник торгов ЕТС -	Участник клиринга, предоставляющий Клиринговому центру денежные средства путем заключения сделок своп в ходе Дополнительной сессии ЕТС второго типа на условиях, определенных в соответствии с Правилами клиринга, с целью исполнения Клиринговым центром своих обязательств по Сделкам перед Добросовестными участниками клиринга.
Участник клиринга -	юридическое лицо, заключившее с Клиринговым центром Договор об оказании клиринговых услуг, а также Банк России, заключивший с Клиринговым центром Договор о взаимодействии, условиями которого, в том числе, предусматривается клиринговое обслуживание Банка России.
Фонд -	Фонд покрытия рисков ЗАО АКБ «Национальный Клиринговый Центр», формируемый в соответствии с Правилами клиринга в целях обеспечения исполнения обязательств по Сделкам любого из Участников клиринга, внесших взнос в Фонд в размере, установленном Клиринговым центром.
Центральный курс -	курс, определяемый в соответствии с Правилами клиринга и используемый для целей переоценки рыночных рисков по неисполненным Сделкам и установления значений Верхней и Нижней границы ценового коридора, а также Верхней и Нижней границы диапазона оценки рисков.

Термины и определения, специально не определенные в Правилах клиринга, понимаются так, как они понимаются в Правилах ЕТС, нормативных актах Банка России, иных нормативных правовых актах Российской Федерации.

2. Общие положения

- 2.1. Правила клиринга разработаны на основании и в соответствии с законодательными актами Российской Федерации, нормативными актами Банка России и иными нормативными правовыми актами Российской Федерации, Уставом ЗАО АКБ «Национальный Клиринговый Центр».
- 2.2. Правила клиринга и указанные в них внутренние документы Клирингового центра регулируют отношения, возникающие при осуществлении Клиринговым центром клиринга и иных функций, включая определение обязательств Участников клиринга по уплате комиссионных вознаграждений в пользу Клирингового центра и Администратора, а также порядок взаимодействия между Клиринговым центром и Участниками клиринга, Расчетными банками, Расчетными центрами, Банком России, Администратором.
- 2.3. Правила клиринга, а также все изменения и дополнения к ним, утверждаются Клиринговым центром по согласованию с Администратором.
- 2.4. Клиринговый центр по согласованию с Администратором имеет право в одностороннем порядке вносить изменения и/или дополнения в Правила клиринга (в том числе, путем утверждения Правил клиринга в новой редакции). О вступлении в

силу новой редакции Правил клиринга, а также обо всех изменениях и/или дополнениях к ним Участники клиринга извещаются путем направления уведомлений в форме электронного документа и размещения текста Правил клиринга на Сайте Клирингового центра не позднее, чем за 5 (пять) рабочих дней до даты вступления их в силу.

2.5. Клиринговый центр:

- осуществляет клиринг, выступая в качестве стороны по всем Сделкам с Участниками клиринга, заключаемым в ходе Торговых сессий ЕТС и Дополнительных сессий ЕТС;
- ведет клиринговые регистры, перечень и назначение которых приведены в разделе 11 Правил клиринга, а порядок их использования – в разделах 12-17, 19 Правил клиринга;
- осуществляет взаимодействие с Расчетными банками и Расчетными центрами, Банком России, Администратором;
- осуществляет контроль и управление рисками по Сделкам;
- определяет подлежащие исполнению обязательства и требования по Сделкам каждого Участника клиринга и Клирингового центра, в том числе Итоговые нетто-обязательства и Итоговые нетто-требования;
- контролирует исполнение Участниками клиринга Итоговых нетто-обязательств и обеспечивает исполнение Итоговых нетто-требований перед Участниками клиринга;
- в целях создания условий для исполнения Участниками клиринга обязательств по Сделкам заключает в ходе Дополнительных сессий ЕТС сделки по покупке и/или продаже иностранной валюты, в том числе сделки своп, с Участниками клиринга и/или сделки своп с Банком России;
- формирует и направляет Участникам клиринга отчеты по итогам клиринга;
- формирует и направляет Банку России отчеты по итогам клиринга в соответствии с Договором о взаимодействии;
- формирует Фонд, ведет учет взносов Участников клиринга в Фонд, распоряжается средствами Фонда.

2.6. Перечень инструментов, по которым между Участниками клиринга и Клиринговым центром заключаются Сделки с частичным обеспечением и Сделки с полным обеспечением, устанавливается решением Клирингового центра и размещается на Сайте Клирингового центра.

2.7. Обмен электронными документами между Участником клиринга и Клиринговым центром осуществляется посредством Подсистемы ЭДО НКЦ и/или системы «Клиент-КлирингБанк» и/или системы S.W.I.F.T. (в случаях, установленных Правилами клиринга).

Порядок формирования и передачи электронных документов посредством Подсистемы ЭДО НКЦ предусмотрен Порядком организации электронного документооборота ЗАО АКБ «Национальный Клиринговый Центр» и Договором об обмене электронными документами, заключенным Участником клиринга с Клиринговым центром.

Порядок формирования и передачи электронных документов посредством системы «Клиент-КлирингБанк» предусмотрен Договором об участии в системе «Клиент-КлирингБанк» ЗАО АКБ «Национальный Клиринговый Центр», заключенным Участником клиринга с Клиринговым центром.

Электронные документы, направляемые посредством Подсистемы ЭДО НКЦ, формируются в формате, предусмотренном Порядком организации электронного документооборота ЗАО АКБ «Национальный Клиринговый Центр».

Электронные документы, направляемые посредством Системы «Клиент-КлирингБанк», формируются исключительно средствами Системы «Клиент-КлирингБанк» в формате, поддерживаемом программным обеспечением Системы «Клиент-КлирингБанк».

Электронные документы, направляемые посредством Системы S.W.I.F.T., формируются в форматах, установленных стандартами S.W.I.F.T., с учетом особенностей, установленных внутренними документами Клирингового центра.

В случае несоответствия информации, содержащейся в электронном документе, направленном посредством Подсистемы ЭДО НКЦ, и электронном документе, направленном посредством системы «Клиент-КлирингБанк», и электронном документе, направленном посредством системы S.W.I.F.T., Участники клиринга и Клиринговый центр в первую очередь руководствуются информацией, содержащейся в электронном документе, направленном посредством Подсистемы ЭДО НКЦ, во вторую - посредством системы «Клиент-КлирингБанк», в третью - посредством системы S.W.I.F.T.

- 2.8. Документы, направляемые Участником клиринга Клиринговому центру с использованием Клиринговой системы, являются электронными сообщениями, подписанными АСП Участника клиринга.

Документы и информация, получаемая Участником клиринга из Клиринговой системы, являются электронными сообщениями, подписанными АСП Клирингового центра.

Порядок использования АСП определен в разделе 10 Правил клиринга.

- 2.9. Клиринговый центр формирует отчеты по итогам клиринга для Участников клиринга в форме электронных документов.

Отчеты по итогам клиринга содержат реквизиты, набор полей и информацию, предусмотренные Правилами клиринга.

Отчеты по итогам клиринга подписываются Клиринговым центром с использованием электронной подписи.

По требованию Участника клиринга могут быть изготовлены (распечатаны) копии электронных документов на бумажном носителе.

Копии электронных документов на бумажном носителе и отчеты по итогам клиринга на бумажном носителе подписываются уполномоченным лицом Клирингового центра и передаются Ответственному сотруднику Участника клиринга, действующему на основании доверенности, либо направляются Участнику клиринга по почте заказным письмом с уведомлением. Доверенности на Ответственных сотрудников Участника клиринга предоставляются по форме, приведенной в приложении № 4 к Правилам клиринга.

- 2.10. Клиринговый центр обеспечивает Участнику клиринга с использованием рабочего места Участника торгов ЕТС возможность получения следующей информации из Клиринговой системы:
- о размере Обеспечения Участника клиринга в каждой валюте;
 - о размере Единого лимита Участника клиринга;
 - о размере Лимита, обеспеченного средствами фонда (в случае если для Участника клиринга установлен Лимит, обеспеченный средствами фонда);
 - о размере Торгового лимита Участника клиринга (в случае если для Участника клиринга установлен Торговый лимит);
 - о значении Нетто-обязательства и/или Нетто-требования Участника клиринга в каждой валюте и с каждой Датой исполнения;
 - о размере Обеспечения Участника клиринга в каждой валюте, недостающего для исполнения Нетто-обязательства Участника клиринга в соответствующей валюте с наступившей Датой исполнения;
 - о наличии / отсутствии Маржинального требования Участника клиринга, о сумме Маржинального требования в российских рублях (в случае наличия);
 - о наличии / отсутствии Задолженности Участника клиринга перед Клиринговым центром, о сумме Задолженности Участника клиринга (в случае наличия).
- 2.11. Клиринговый центр предоставляет Участнику клиринга с использованием Клиринговой системы информацию об Итоговых нетто-обязательствах и/или Итоговых нетто-требованиях Участника клиринга в иностранной валюте и/или Итоговых обязательствах и/или Итоговых требованиях Участника клиринга в российских рублях.
- В случае несоответствия информации, полученной Участником клиринга с использованием Клиринговой системы, и информации, содержащейся в подписанном уполномоченным лицом Клирингового центра Биржевом свидетельстве, расчеты должны осуществляться Участником клиринга на основании Биржевого свидетельства.
- 2.12. В целях исполнения и обеспечения исполнения обязательств по Сделкам Клиринговый центр открывает счета в Расчетных банках и Расчетных центрах. Перечни Расчетных банков и Расчетных центров определяются решением Клирингового центра и размещаются на Сайте Клирингового центра.
- Об изменениях в платежных реквизитах Клиринговый центр оповещает Участника клиринга путем направления ему новых платежных реквизитов Клирингового центра в форме электронного документа и путем размещения соответствующей информации на Сайте Клирингового центра не позднее, чем за 3 (три) рабочих дня до введения этих изменений в действие.
- 2.13. Денежные средства, перечисленные Участником клиринга на счета Клирингового центра, открытые в Расчетных банках и Расчетных центрах, в качестве Обеспечения, являются имуществом, переданным Участником клиринга Клиринговому центру для обеспечения исполнения обязательств Участника клиринга перед Клиринговым центром по Сделкам в соответствии с Правилами клиринга и для исполнения обязательств Участника клиринга перед Клиринговым центром по Сделкам и уплате комиссионных вознаграждений, а также для обеспечения исполнения нетто-

обязательств Участника клиринга, определяемых в соответствии с разделом 6 Правил клиринга в случае отзыва (аннулирования) Банком России у Участника клиринга - кредитной организации лицензии на осуществление банковских операций или в случае ликвидации Участника клиринга, а также в случае отзыва (аннулирования) у Участника клиринга – Банка-нерезидента специального разрешения (лицензии или иного основания) компетентного органа государства учреждения Банка-нерезидента, в соответствии с которым Банк-нерезидент имеет право осуществлять банковские операции.

- 2.14. Денежные средства, перечисленные Участником клиринга на счета Клирингового центра, открытые в Расчетных банках и Расчетных центрах, в качестве вноса в Фонд, являются имуществом, переданным Участником клиринга Клиринговому центру для обеспечения исполнения обязательств по Сделкам в соответствии с Правилами клиринга.
- 2.15. Фонд формируется Клиринговым центром в долларах США за счет взносов в Фонд Участников клиринга.
Размер взноса в Фонд составляет 80 000 (восемьдесят тысяч) долларов США.
- 2.16. Клиринговый центр взаимодействует с Администратором в соответствии с заключенным договором, определяющим порядок и условия взаимодействия сторон договора при осуществлении Клиринговым центром клиринга и иных функций, связанных с осуществлением клиринга по Сделкам, заключенным Участниками торгов, одновременно являющимися Участниками клиринга, допущенными Администратором к торгам на ЕТС, а также при организации торгов на ЕТС Администратором.
Администратор обеспечивает участие Клирингового центра в заключении сделок на ЕТС в соответствии с Правилами ЕТС, формирует и предоставляет Клиринговому центру выписки из реестров подтверждений и реестров сделок, обеспечивает проведение Дополнительной сессии ЕТС на основании уведомления Клирингового центра о необходимости проведения Дополнительной сессии и осуществляет иные действия, предусмотренные Правилами клиринга и Правилами ЕТС.
- 2.17. Условиями Договора о взаимодействии между Администратором, Клиринговым центром и Банком России предусматривается клиринговое обслуживание Банка России в ходе Торговых сессий ЕТС, порядок взаимодействия в ходе Торговых и Дополнительных сессий ЕТС, а также порядок документооборота между ними.
Банк России осуществляет операции по покупке и продаже иностранной валюты на торгах на основании законодательства Российской Федерации, в соответствии с Правилами ЕТС и без внесения Обеспечения и взноса в Фонд. Единый лимит и иные ограничения на объем указанных операций для Банка России не устанавливаются.
Раздел 4 Правил клиринга не распространяется на Банк России. Положения Правил клиринга (за исключением положений раздела 4 Правил клиринга) распространяются на Банк России, если иные положения в отношении Банка России не предусмотрены Договором о взаимодействии и/или Правилами клиринга.
- 2.17.1. Банк России согласно законодательству Российской Федерации, выполняя функции регулятора валютного рынка, вправе по запросу получать от Клирингового центра полную информацию об итогах исполнения Участниками клиринга и Клиринговым

центром обязательств по Сделкам.

3. Договор об оказании клиринговых услуг

- 3.1. Образцы Договоров об оказании клиринговых услуг, заключаемых Клиринговым центром с Участниками клиринга, приведены в приложении №28 к Правилам клиринга.
- 3.2. Заключение Договора об оказании клиринговых услуг осуществляется путем присоединения к указанному договору, условия которого определены Правилами клиринга.
- 3.3. Размер оплаты клиринговых и иных связанных с клирингом услуг Клирингового центра предусмотрен Тарифами комиссионного вознаграждения за услуги, предоставляемые клиентам ЗАО АКБ «Национальный Клиринговый Центр» и/или Тарифами комиссионного вознаграждения за услуги, предоставляемые ЗАО АКБ «Национальный Клиринговый Центр» Международным организациям, в отношении которых в соответствии с законодательством Российской Федерации применяется ставка налога на добавленную стоимость в размере ноль процентов, утвержденными Клиринговым центром (далее – Тарифы Клирингового центра).
- 3.4. Порядок оплаты клиринговых и иных связанных с клирингом услуг Клирингового центра определен в разделе 18 Правил клиринга.
- 3.5. Клиринговые и иные связанные с клирингом услуги Клирингового центра считаются оказанными надлежащим образом, если в течение 5 (пяти) рабочих дней после окончания месяца, в течение которого оказывались услуги, Участник клиринга письменно не заявит об обратном.
- 3.6. В случае нарушения Клиринговым центром своих обязательств, установленных Правилами клиринга, Клиринговый центр обязан возместить Участнику клиринга понесенные им убытки.
- 3.7. Участник клиринга вправе отказаться от исполнения Договора об оказании клиринговых услуг только при отсутствии у него имущественных обязательств по указанному договору, а также неисполненных им обязательств, допущенных к клирингу, письменно уведомив об этом Клиринговый центр не позднее, чем за 7 (семь) дней до даты расторжения Договора об оказании клиринговых услуг.
- 3.8. Клиринговый центр вправе отказаться от исполнения Договора об оказании клиринговых услуг с Участником клиринга в случае нарушения Участником клиринга требований, предъявляемых к нему Правилами клиринга.
- 3.9. Действие Договора об оказании клиринговых услуг прекращается в следующих случаях:
 - прекращения допуска Участника клиринга к клиринговому обслуживанию в соответствии со всеми правилами клиринга, утвержденными Клиринговым центром;
 - ликвидации Участника клиринга, а также в случае реорганизации Участника

клиринга при условии, что деятельность Участника клиринга в результате реорганизации прекращается;

- отзыва (аннулирования) лицензии на осуществление банковских операций у Участника клиринга (для кредитных организаций);
- аннулирование специального разрешения (лицензии или иного основания), выданного центральным (национальным) банком стороны Международного соглашения или иным органом государственного управления, который в соответствии с законодательством стороны Международного соглашения осуществляет валютное регулирование и банковский надзор, на основании которого Банк-нерезидент имеет право осуществлять банковские операции (для Банков-нерезидентов).

3.10. Прекращение действия Договора об оказании клиринговых услуг не освобождает Участника клиринга и Клиринговый центр от исполнения обязательств, возникших до прекращения действия Договора об оказании клиринговых услуг.

3.11. Если Участник клиринга является Банком-нерезидентом или Международной организацией, применимым правом, регулирующим Договор об оказании клиринговых услуг и связанные с ним отношения Участника клиринга и Клирингового центра, является законодательство Российской Федерации.

4. Требования к Участникам клиринга

4.1. Участником клиринга может стать кредитная организация, юридическое лицо, являющееся резидентом Российской Федерации и не являющееся кредитной организацией (далее – некредитная организация), Государственная корпорация, Банк-нерезидент или Международная организация.

4.2. Для заключения Договора об оказании клиринговых услуг юридическое лицо предоставляет Клиринговому центру:

- Договор об оказании клиринговых услуг по форме, предусмотренной Приложением № 28 к Правилам клиринга, в 2 (двух) экземплярах, подписанный уполномоченным лицом юридического лица и скрепленный печатью юридического лица;
- комплект документов в соответствии с перечнем, приведенным в приложении № 42 к Правилам клиринга;

В случае если какой-либо из документов, указанных в приложении № 42 к Правилам клиринга, ранее уже предоставлялся Клиринговому центру и имеется в наличии у Клирингового центра, то юридическое лицо по предварительному согласованию с Клиринговым центром может быть освобождено от обязанности повторного предоставления этого документа.

4.3. Юридическое лицо обязано предоставить иные документы, которые могут быть запрошены Клиринговым центром в необходимых случаях в целях, не противоречащих действующему законодательству Российской Федерации.

4.4. В случае если между юридическим лицом и Клиринговым центром заключен Договор об оказании клиринговых услуг по форме, установленной приложением 28 к

Правилам клиринга, для осуществления клирингового обслуживания на других рынках, то заключение нового Договора об оказании клиринговых услуг в соответствии с настоящими Правилами клиринга не требуется.

- 4.5. Участник клиринга обязан ежегодно предоставлять Клиринговому центру Анкету Участника клиринга (клиента) (Регистрационную карточку) в форме электронного документа.

В случае изменения сведений, содержащихся в Анкете Участника клиринга (клиента) (Регистрационной карточке) или в иных представленных Клиринговому центру документах, Участник клиринга обязан в течение 5 (пяти) рабочих дней после таких изменений предоставить Клиринговому центру Анкету Участника клиринга (клиента) (Регистрационную карточку) с обновленной информацией в форме электронного документа и соответствующие документы, подтверждающие такие изменения.

Форматы предоставления Участником клиринга Анкеты Участника клиринга (клиента) (Регистрационной карточки) определены Порядком предоставления информации и отчетности.

- 4.6. Для подтверждения своего финансового состояния Участники клиринга обязаны в течение всего срока действия Договора об оказании клиринговых услуг предоставлять Клиринговому центру отчетность в соответствии с приложением № 43 к Правилам клиринга.

В целях оценки финансового состояния Участника клиринга Клиринговый центр вправе затребовать от Участника клиринга дополнительную информацию и отчетность, не указанную в приложении № 43 к Правилам клиринга.

5. Условия клирингового обслуживания. Порядок предоставления допуска к клиринговому обслуживанию

- 5.1. Допуск к клиринговому обслуживанию в соответствии с Правилами клиринга предоставляется Участнику клиринга, который соответствует следующим требованиям:

- имеет действующий Договор об оказании клиринговых услуг, заключенный с Клиринговым центром;
- имеет действующую лицензию на осуществление банковских операций, выданную Банком России (для кредитных организаций);
- имеет специальное разрешение (лицензию или иное основание), выданное центральным (национальным) банком стороны Международного соглашения или иным органом государственного управления, который в соответствии с законодательством стороны Международного соглашения осуществляет валютное регулирование и банковский надзор, на основании которого Банк-нерезидент имеет право осуществлять банковские операции (для банков-нерезидентов) (применяется за исключением Государственной корпорации и Международной организации);
- является участником Подсистемы ЭДО НКЦ;
- выполняет требования Клирингового центра по предоставлению информации и отчетности, предусмотренные пунктами 4.5-4.6 Правил клиринга;
- выполняет требования Клирингового центра к финансовому состоянию

Участника клиринга, предусмотренные пунктом 5.2 Правил клиринга;

- Участник клиринга - некредитная организация имеет собственные средства (капитал) не менее 180 000 000 (ста восьмидесяти миллионов) рублей;
- предоставил Клиринговому центру Перечень платежных реквизитов в форме электронного документа или документа на бумажном носителе (по форме приложения № 3 к Правилам клиринга), содержащий платежные реквизиты Счетов в российских рублях и в иностранной валюте для возврата денежных средств, учитываемых по основному Расчетному коду Участника клиринга.

В случае если владельцем Счета для возврата денежных средств, указанного в Перечне платежных реквизитов, является Клиент Участника клиринга, Участник клиринга вместе с таким Перечнем платежных реквизитов предоставляет Клиринговому центру письмо по форме, установленной приложением № 32 к Правилам клиринга.

В случае если Участник клиринга планирует получать клиринговые услуги только через свой(и) филиал(ы), Участнику клиринга необходимо предоставить платежные реквизиты только по своему (своим) филиалу(филиалам).

Участникам клиринга рекомендуется открывать корреспондентские счета в иностранной валюте в банках, имеющих инвестиционный рейтинг не ниже "BBB" по классификации рейтингового агентства S&P (Standard & Poor's) или рейтинг не ниже аналогичного по классификациям "Fitch Ratings" или "Moody's" и созданных на территориях иностранных государств, принадлежащих к группе развитых стран, признаваемых таковыми в соответствии с нормативными актами Банка России.

- в деятельности Участника клиринга отсутствуют факты ухудшения его финансового состояния и/или отсутствует информация, дающая основания считать возможными ухудшение финансового состояния Участника клиринга и/или неспособность Участника клиринга своевременно и в полном объеме исполнять свои обязательства по Сделкам с частичным обеспечением, Маржинальные требования и/или иные обязательства Участника клиринга, возникающие из Правил клиринга.

5.2. Участник клиринга должен соответствовать следующим требованиям к финансовому состоянию:

- кредитные организации и Банки-нерезиденты - соблюдать обязательные нормативы Банка России, установленные для кредитных организаций или обязательные нормативы, установленные компетентным органом государства учреждения Банка-нерезидента (в случае если в соответствии с национальным законодательством государства учреждения Банка-нерезидента такие обязательные нормативы устанавливаются);
- кредитные организации - иметь по балансу на последнюю отчетную дату положительный финансовый результат текущего года, определяемый как разница между суммой остатков, числящихся на балансовых счетах по учету доходов текущего года, и суммой остатков, числящихся на балансовых счетах по учету расходов текущего года;
- Государственные корпорации, Международные организации, некредитные организации - иметь по балансу на последнюю отчетную дату положительный финансовый результат деятельности, определяемый как прибыль после

налогообложения ;

- Банки-нерезиденты - иметь по финансовой отчетности, предоставляемой Банками-нерезидентами в соответствии с Правилами клиринга, на последнюю отчетную дату положительный финансовый результат деятельности, определяемый как прибыль после налогообложения ;
- в деятельности Участников клиринга - кредитных организаций и Банков-нерезидентов должны отсутствовать основания для осуществления мер по предупреждению банкротства в соответствии с законодательством Российской Федерации о несостоятельности (банкротстве) или в соответствии с национальным законодательством государства учреждения, а также основания для отзыва Банком России лицензии на осуществление банковских операций в соответствии с законодательством Российской Федерации о банковской деятельности или основания для отзыва лицензии на осуществление банковских операций в соответствии с национальным законодательством государства учреждения Банка-.

- 5.3. Участники клиринга должны соответствовать требованиям, приведенным в пунктах 5.1-5.2 Правил клиринга, в течение всего времени допуска к клиринговому обслуживанию в соответствии с Правилами клиринга.
- 5.4. О факте предоставления Участнику клиринга допуска к клиринговому обслуживанию Клиринговый центр извещает Участника клиринга и Администратора не позднее рабочего дня, следующего за днем предоставления допуска к клиринговому обслуживанию, направляя соответствующие уведомления в форме электронного документа.
- 5.5. Участники клиринга - Кредитные организации, Государственные корпорации и Международные организации, имеют право участия в Фонде.
Если Участник клиринга намерен участвовать в Фонде, ему необходимо предоставить заявление на участие в Фонде (по форме, предусмотренной приложением № 5 к Правилам клиринга) и получить заключение от Администратора, предусматривающее возможность участия в Фонде.
- 5.6. Размер собственных средств (капитала) Участников клиринга, являющихся или намеревающихся стать участниками Фонда, рассчитанный в соответствии с требованиями нормативного правового акта Банка России, устанавливающего порядок определения собственных средств (капитала) кредитных организаций, на момент вступления в Фонд и в течение всего времени участия в Фонде должен составлять не менее 10 (десяти) миллионов евро по курсу Банка России для Участников клиринга, являющихся банками, и не менее 5 (пяти) миллионов евро по курсу Банка России для Участников клиринга - небанковских кредитных организаций.
- 5.7. Клиринговый центр уведомляет Участника клиринга о принятии или отказе в принятии его в Фонд в течение 2 (двух) рабочих дней со дня принятия такого решения путем направления информационного письма в адрес Участника клиринга в форме электронного документа.
- 5.8. Клиринговый центр вправе принять решение о прекращении участия в Фонде Участника клиринга в случае нарушения им требований для участия в Фонде,

установленных Правилами клиринга.

Клиринговый центр уведомляет Участника клиринга о прекращении его участия в Фонде и дате прекращения его участия в Фонде не позднее рабочего дня, следующего за днем принятия такого решения, путем направления информационного письма в адрес Участника клиринга в форме электронного документа.

- 5.9. В случае необходимости изменения реквизитов Счетов для возврата денежных средств, Участник клиринга направляет Клиринговому центру реквизиты новых Счетов для возврата денежных средств в форме электронного документа или документа на бумажном носителе по форме, установленной приложением № 3 к Правилам клиринга, не позднее, чем за три рабочих дня до даты начала проведения операций с использованием новых Счетов для возврата денежных средств.

В случае если владельцем Счета для возврата денежных средств, указанного в Перечне платежных реквизитов (приложении № 3 к Правилам клиринга), является Клиент Участника клиринга, Участник клиринга вместе с таким Перечнем платежных реквизитов предоставляет Клиринговому центру письмо по форме, установленной приложением № 32 к Правилам клиринга.

- 5.10. Участники клиринга обязаны по запросу Клирингового центра не позднее следующего рабочего дня со дня получения запроса предоставить Клиринговому центру информацию, содержащую:

- сведения о наличии или отсутствии у Участника клиринга неисполненных обязательств перед кредиторами, вкладчиками и (или) по уплате обязательных платежей в связи с отсутствием или недостаточностью денежных средств на его счетах;
- Участники клиринга – кредитные организации - иные сведения, свидетельствующие о наличии или отсутствии в деятельности Участника клиринга оснований для осуществления мер по предупреждению банкротства, указанных в законодательстве Российской Федерации о несостоятельности (банкротстве) кредитных организаций, для отзыва Банком России лицензии на осуществление банковских операций в соответствии с законодательством Российской Федерации о банковской деятельности;
- Участники клиринга – Банки-нерезиденты – иные сведения, свидетельствующие о наличии или отсутствии в деятельности Банка-нерезидента оснований для осуществления мер по предупреждению банкротства в соответствии с национальным законодательством государства учреждения Банка-нерезидента, а также основания для отзыва лицензии на осуществления банковских операций в соответствии с национальным законодательством государства учреждения Банка-нерезидента;
- Участники клиринга – некредитные организации - иные сведения, свидетельствующие о наличии или отсутствии в деятельности Участника клиринга оснований для осуществления мер по предупреждению банкротства, указанных в законодательстве Российской Федерации о несостоятельности (банкротстве) организаций, в том числе – профессиональных участников рынка ценных бумаг.

6. Порядок регистрации Участников клиринга и их Клиентов

- 6.1. Клиринговый центр осуществляет регистрацию Участников клиринга и их Клиентов и присваивает каждому Участнику клиринга / Клиенту Расчетный код и/или код Клиента Участника клиринга, соответственно.
- 6.1.1. Участнику клиринга соответствует один основной Регистрационный код (идентификатор), присвоенный Участнику клиринга Администратором.
- 6.1.2. Администратором Участнику клиринга могут быть присвоены дополнительные Регистрационные коды (идентификаторы). При этом заключение нового Договора об оказании клиринговых услуг не требуется.
- 6.1.3. При получении от Администратора информации о присвоении Участнику клиринга Регистрационного кода (идентификатора), Участнику клиринга Клиринговым центром присваивается основной Расчетный код в рамках Регистрационного кода (идентификатора) (основного или дополнительного).
- 6.1.4. На основании заявления Участника клиринга, предоставленного Клиринговому центру, Участнику клиринга может быть присвоен дополнительный Расчетный код в рамках одного Регистрационного кода (идентификатора) (основного или дополнительного).
- Заявление о присвоении дополнительного Расчетного кода направляется Клиринговому центру на бумажном носителе по форме, установленной приложением № 29 к Правилам клиринга, или в форме электронного документа.
- Заявление о присвоении дополнительного Расчетного кода должно содержать платежные реквизиты для регистрации Счетов для возврата денежных средств для данного дополнительного Расчетного кода.
- В случае если владельцем Счета для возврата денежных средств, указанного в Заявлении о присвоении дополнительного Расчетного кода, является Клиент Участника клиринга, Участник клиринга вместе с таким заявлением предоставляет Клиринговому центру письмо по форме, установленной приложением № 32 к Правилам клиринга.
- 6.1.5. Клиринговый центр информирует Участника клиринга о присвоенном ему Расчетном коде не позднее рабочего дня, следующего за днем присвоения Расчетного кода, посредством Подсистемы ЭДО НКЦ, если на момент присвоения Участнику клиринга Расчетного кода Участник клиринга является участником Подсистемы ЭДО НКЦ, либо путем направления Участнику клиринга уведомления на бумажном носителе.
- 6.1.6. Депонирование Участником клиринга денежных средств, уплата комиссионных вознаграждений и расчеты с Клиринговым центром осуществляются отдельно по каждому Расчетному коду Участника клиринга.
- 6.1.7. Расчет Единого лимита, определение Нетто-обязательств / Нетто-требований, Итоговых нетто-обязательств / Итоговых нетто-требований, Итоговых обязательств / Итоговых требований, Задолженностей Участника клиринга, проверка возможности регистрации в ТС заявок, перечисление и учет денежных средств Участника клиринга, исполнение (прекращение) обязательств по Сделкам, возникновение и прекращение Маржинального требования, заключение и исполнение Сделок в ходе Дополнительных сессий ЕТС первого и второго типа, уплата комиссионных вознаграждений осуществляется по Расчетному коду Участника клиринга.

- 6.1.8. Аннулирование присвоенного Участнику клиринга основного и дополнительных Расчетных кодов осуществляется при аннулировании соответствующего ему Регистрационного кода на основании уведомления, полученного от Администратора.
Аннулирование присвоенного Участнику клиринга дополнительного Расчетного кода осуществляется на основании письма от Участника клиринга.
- 6.1.9. Аннулирование присвоенного Участнику клиринга основного или дополнительного Расчетного кода осуществляется при условии отсутствия у Участника клиринга неисполненных обязательств, учитываемых по такому Расчетному коду.
- 6.1.10. При аннулировании присвоенного Участнику клиринга Расчетного кода Клиринговый центр в течение 3 (трех) банковских дней после получения соответствующего уведомления от Администратора или письма от Участника клиринга, осуществляет возврат Обеспечения Участнику клиринга в соответствующей валюте, учитываемого по данному Расчетному коду, на Счета для возврата денежных средств, зарегистрированные в Клиринговом центре для данного Расчетного кода.
- 6.1.11. Клиринговый центр информирует Участника клиринга об аннулировании Расчетного кода не позднее рабочего дня, следующего за днем его аннулирования, посредством Подсистемы ЭДО НКЦ.
- 6.2. Регистрация Клиентов Участников клиринга осуществляется на основании информации, полученной от Участника клиринга, или на основании информации, предоставленной Клиринговому центру Администратором.
- 6.3. Регистрация Клиентов осуществляется Клиринговым центром в соответствии с порядком, аналогичном порядку, установленному требованиями нормативных правовых актов о регистрации клиентов на фондовых биржах.
- 6.4. Сведения, необходимые для регистрации Клиента предоставляются Участником клиринга в Клиринговый центр в форме электронного документа.
- 6.5. Процедура регистрации Клиентов Участников клиринга предусматривает присвоение Клиринговым центром таким Клиентам следующих уникальных кодов:
- код Клиента (присваивается в соответствии с нормативными правовыми актами о регистрации клиентов на фондовых биржах);
 - краткий код Клиента (указывается Участником клиринга самостоятельно).
- 6.6. Краткий код Клиента присваивается Клиенту при условии, что:
- Участнику клиринга присвоен Регистрационный код;
 - Клиенту Участника клиринга присвоен код Клиента в соответствии с Правилами клиринга;
 - краткий код Клиента, предложенный Участником клиринга, соответствует формату (набор символов), используемому в Клиринговой системе, и является уникальным для данного Участника клиринга.
- 6.7. Клиенту Участника клиринга может быть присвоен только один код Клиента Участника клиринга. Клиенту Участника клиринга может быть присвоено в Клиринговой системе более одного краткого кода Клиента. Для каждого Клиента устанавливается однозначное соответствие всех кратких кодов Клиента коду Клиента.

- 6.8. Клиринговый центр информирует Участников клиринга о присвоении Клиентам кодов (в том числе, кратких) путем направления соответствующего уведомления.
- 6.9. Для регистрации Администратором Клиента Участника клиринга в качестве клиента Участника торгов Клиринговый центр вправе передавать имеющуюся у него информацию о Клиентах, а также о присвоенных им кодах Администратору.
- 6.10. Клиринговый центр вправе самостоятельно аннулировать регистрацию Клиентов в случае несоблюдения требований, установленных Правилами клиринга.
- 6.11. Участник клиринга самостоятельно отслеживает полноту и актуальность информации, предоставляемой в целях регистрации кодов Участника клиринга и кодов Клиента. Клиринговый центр не несет ответственности за актуальность и достоверность информации, предоставленной Участником клиринга, а также за нарушение Участником клиринга порядка предоставления таких сведений.
- 7. Порядок приостановления и прекращения допуска к клиринговому обслуживанию**
- 7.1. Клиринговый центр вправе приостановить допуск к клиринговому обслуживанию (в том числе по одному или нескольким инструментам) Участника клиринга по любому из следующих оснований:
- на основании соответствующего уведомления Администратора;
 - при возникновении обстоятельств, препятствующих в соответствии с законодательством Российской Федерации заключению и/или исполнению Участником клиринга сделок на ЕТС (за исключением чрезвычайных ситуаций), ставших известными Клиринговому центру;
 - при нарушении Участником клиринга установленных Правилами клиринга требований;
 - при применении Банком России к Участнику клиринга – кредитной организации санкций за нарушение банковского законодательства, в том числе: введение запрета на осуществление Участником клиринга отдельных банковских операций, если это приведет к невозможности заключения и/или исполнения Участником клиринга сделок на ЕТС и назначение временной администрации по управлению кредитной организацией – Участником клиринга в рамках мер по предупреждению банкротства кредитной организации;
 - при применении к Участнику клиринга санкций уполномоченных органов за нарушение законодательства Российской Федерации, в том числе: применение административных наказаний, ограничений и введение запрета на проведение Участником клиринга отдельных операций;
 - наличие в деятельности Участника клиринга оснований для осуществления мер по предупреждению банкротства в соответствии с законодательством Российской Федерации о несостоятельности (банкротстве), а также оснований для отзыва (аннулирования) уполномоченным федеральным органом исполнительной власти лицензии на осуществление соответствующего вида деятельности в соответствии с законодательством Российской Федерации;
 - при получении Клиринговым центром письменного сообщения от

компетентного органа государства учреждения Банка-нерезидента в отношении Банка-нерезидента, из которого следует невозможность дальнейшего осуществления клирингового обслуживания Банка-нерезидента;

- по результатам рассмотрения Клиринговым центром предоставленных Участником клиринга в соответствии с пунктами 4.5-4.6 Правил клиринга информации и документов, а также в случае их непредставления в сроки, установленные пунктом 4.5 Правил клиринга;
- в случае приостановления Международного соглашения для Российской Федерации либо в случае приостановления Международного соглашения для государства Стороны Международного соглашения, являющегося государством учреждения такого Участника-клиринга – Банка-нерезидента;
- в случае приостановления международного договора для Российской Федерации, в соответствии с которым Международная организация учреждена либо в случае принятия решения уполномоченными лицами сторон указанного международного договора о приостановлении деятельности Международной организации;
- при наличии фактов ухудшения финансового состояния Участника клиринга и/или информации, дающей основания считать возможными ухудшение финансового состояния Участника клиринга и/или неспособность Участника клиринга своевременно и в полном объеме исполнять свои обязательства по Сделкам, Маржинальные требования и/или иные обязательства Участника клиринга, возникающие из Правил клиринга.

- 7.2. Клиринговый центр приостанавливает допуск Участника клиринга к клиринговому обслуживанию при получении Клиринговым центром от Участника клиринга письма о приостановлении допуска к клиринговому обслуживанию.
- 7.3. В случае приостановления допуска к клиринговому обслуживанию Клиринговый центр продолжает осуществлять клиринг и иные функции, связанные с осуществлением клиринга по Сделкам, заключенным данным Участником клиринга до момента приостановления допуска к клиринговому обслуживанию Участника клиринга или до момента приостановления допуска к клиринговому обслуживанию по одному или нескольким инструментам.
- 7.4. После получения Клиринговым центром от Участника клиринга и/или Администратора информации и/или документов, подтверждающих выполнение Участником клиринга требований Правил клиринга, и на основании соответствующего письма Участника клиринга Клиринговый центр вправе принять решение о возобновлении приостановленного клирингового обслуживания Участника клиринга или о возобновлении приостановленного клирингового обслуживания Участника клиринга по одному или нескольким инструментам.
- 7.5. Клиринговый центр прекращает допуск Участника клиринга к клиринговому обслуживанию по любому из следующих оснований:
- в случае прекращения действия Договора об оказании клиринговых услуг при условии отсутствия неисполненных обязательств, возникших до прекращения его действия;
 - в случае отзыва (аннулирования) Банком России лицензии на осуществление

банковских операций у Участника клиринга – кредитной организации;

- в случае назначения временной администрации или принятия арбитражным судом решения о введении в отношении Участника клиринга одной из процедур банкротства;
- ликвидации Участника клиринга, а также в случае реорганизации Участника клиринга при условии, что деятельность Участника клиринга в результате реорганизации прекращается;
- в случае отзыва (аннулирования) специального разрешения (лицензии или иного основания) компетентного органа государства учреждения Банка-нерезидента, в соответствии с которым Банк-нерезидент имеет право осуществлять банковские операции;
- в случае прекращения Международного соглашения для Российской Федерации либо со дня прекращения Международного соглашения для государства - стороны Международного соглашения, являющегося государством учреждения Участника-клиринга – Банка-нерезидента;
- в случае прекращения международного договора, в соответствии с которым учреждена Международная организация, для Российской Федерации либо со дня принятия решения уполномоченными лицами сторон указанного международного договора о прекращении деятельности Международной организации;
- в случае принятия федерального закона о ликвидации Государственной корпорации;
- неоднократного (два и более) неисполнения Участником клиринга своих обязательств по Сделкам и/или обязательств Участника клиринга, возникающих на основании Правил клиринга;
- неоднократного (два и более) нарушения Участником клиринга установленных Правилами клиринга требований.

- 7.6. Клиринговый центр вправе прекратить допуск Участника клиринга к клиринговому обслуживанию при поступлении в Клиринговый центр уведомления от Администратора о прекращении допуска Участника клиринга к участию в торгах, проводимых Администратором.
- 7.7. С момента получения в отношении Участника клиринга информации о случаях, указанных в пунктах 7.1, 7.5 Правил клиринга, Клиринговый центр вправе установить для такого Участника клиринга Лимит, обеспеченный средствами фонда, равным нулю.
- 7.8. Клиринговый центр извещает Участника клиринга и Администратора о приостановлении / прекращении или возобновлении приостановленного допуска к клиринговому обслуживанию (в том числе, по одному или нескольким инструментам) не позднее рабочего дня, следующего за днем приостановления / прекращения или возобновления приостановленного допуска к клиринговому обслуживанию, направляя соответствующие уведомления в форме электронного документа.
- 7.9. Прекращение допуска к клиринговому обслуживанию влечет за собой прекращение участия в Фонде Участника клиринга с даты прекращения допуска к клиринговому

обслуживанию. Клиринговый центр возвращает Участнику клиринга денежные средства, составляющие взнос Участника клиринга в Фонд, учитываемый на дату прекращения допуска к клиринговому обслуживанию, в течение 3 (трех) банковских дней после получения Клиринговым центром письма от Участника клиринга о возврате вклада в Фонд, содержащего платежные реквизиты, за исключением случаев, указанных в разделе 8 Правил клиринга.

8. Порядок урегулирования неисполненных обязательств в случае прекращения допуска к клиринговому обслуживанию

- 8.1. В случае отзыва (аннулирования) Банком России у Участника клиринга – кредитной организации лицензии на осуществление банковских операций, допуск к клиринговому обслуживанию Участника клиринга - кредитной организации прекращается с даты отзыва (аннулирования) Банком России у такого Участника клиринга лицензии на осуществление банковских операций.
- 8.1.1. Подтверждением факта отзыва (аннулирования) лицензии на осуществление банковских операций у Участника клиринга - кредитной организации является письменное уведомление Банка России, направленное Клиринговому центру (в том числе, посредством факсимильной связи) и/или размещенная Пресс-центром Банка России на сайте Банка России в сети Интернет информация о решении Банка России об отзыве (аннулировании) выданной Участнику клиринга - кредитной организации лицензии на осуществление банковских операций и/или направленное Пресс-центром Банка России по электронному адресу Клирингового центра электронное сообщение, содержащее информацию об отзыве (аннулировании) у Участника клиринга - кредитной организации лицензии на осуществление банковских операций.
- 8.1.2. В случае отзыва (аннулирования) лицензии на осуществление банковских операций у Участника клиринга – кредитной организации, обязательства по Сделкам, заключенным до даты отзыва (аннулирования) такой лицензии, прекращаются полностью на дату, предшествующую дате отзыва (аннулирования) лицензии на осуществление банковских операций у Участника клиринга – кредитной организации. Указанные обязательства прекращаются возникновением нетто-обязательства /нетто-требования Участника клиринга – кредитной организации, рассчитанного в соответствии с пунктом 8.7 Правил клиринга, если Участник клиринга решением суда признан несостоятельным (банкротом), или рассчитанного в соответствии с пунктом 8.8 Правил клиринга, если в отношении Участника клиринга принято решение суда о его ликвидации. Такое нетто-обязательство / нетто-требование Участника клиринга – кредитной организации подлежит исполнению после вступления в силу соответствующего решения арбитражного суда.
- 8.1.3. В случае отзыва (аннулирования) лицензии на осуществление банковских операций у Участника клиринга – кредитной организации, Сделки, заключенные в дату отзыва (аннулирования) такой лицензии и (или) после нее, являются недействительными. Клиринговый центр вправе предъявить к Участнику клиринга требование о взыскании убытков, связанных с недействительностью указанных сделок, а также неустоек (штрафов, пеней) и комиссионных вознаграждений, подлежащих уплате в соответствии с Правилами клиринга, в общем порядке, предусмотренном законодательством о несостоятельности (банкротстве).
- 8.1.4. Клиринговый центр направляет Участнику клиринга - кредитной организации, у которого отозвана (аннулирована) лицензия на осуществление банковских операций,

в форме электронного документа уведомление о прекращении обязательств по Сделкам не позднее Рабочего дня, следующего за датой прекращения обязательств по этим Сделкам.

- 8.1.5. Клиринговый центр в порядке, предусмотренном пунктом 8.7 или 8.8 Правил клиринга, рассчитывает сумму нетто-обязательства / нетто-требования Участника клиринга – кредитной организации и направляет такому Участнику клиринга в форме электронного документа уведомление о рассчитанной в соответствии с пунктом 8.7 или 8.8 Правил клиринга сумме нетто-обязательства или нетто-требования Участника клиринга.
- 8.1.6. Возврат денежных средств Участнику клиринга – кредитной организации осуществляется Клиринговым центром в течение 3 (трех) банковских дней после получения Клиринговым центром письма о возврате денежных средств от уполномоченного органа кредитной организации, содержащего платежные реквизиты, а также документов, подтверждающих полномочия указанного органа (если они ранее не были переданы Клиринговому центру), но не ранее дня вступления в силу решения арбитражного суда о признании Участника клиринга несостоятельным (банкротом) или о ликвидации Участника клиринга.
Возврат денежных средств Участнику клиринга – кредитной организации осуществляется Клиринговым центром в сумме нетто-требования Участника клиринга, рассчитанного соответственно в порядке, предусмотренном пунктом 8.7 или 8.8 Правил клиринга.
- 8.1.7. Клиринговый центр вправе предъявить к Участнику клиринга – кредитной организации требование о взыскании нетто-обязательства Участника клиринга, рассчитанного соответственно в порядке, предусмотренном пунктом 8.7 или 8.8 Правил клиринга, в общем порядке, предусмотренном законодательством о несостоятельности (банкротстве).
- 8.1.8. После принятия арбитражным судом решения о признании Участника клиринга – кредитной организации несостоятельным (банкротом) или о ликвидации Участника клиринга и направления ему уведомления о рассчитанных нетто-обязательствах / нетто-требованиях Клиринговый центр направляет такому Участнику клиринга в форме электронного документа уведомление о прекращении действия Договора об оказании клиринговых услуг.
- 8.2. В случае назначения временной администрации или принятия арбитражным судом решения о введении в отношении Участника клиринга – некредитной организации одной из процедур банкротства, допуск к клиринговому обслуживанию Участника клиринга - некредитной организации прекращается с даты назначения временной администрации или даты принятия арбитражным судом решения о введении в отношении Участника клиринга одной из процедур банкротства, в зависимости от того, какая дата наступила ранее.
- 8.2.1. В случае назначения временной администрации или принятия арбитражным судом решения о введении в отношении Участника клиринга – некредитной организации одной из процедур банкротства, обязательства по Сделкам прекращаются полностью в дату прекращения допуска к клиринговому обслуживанию.
Указанные обязательства по Сделкам прекращаются возникновением нетто-обязательства / нетто-требования Участника клиринга – некредитной организации, рассчитанных в соответствии с пунктом 8.8 Правил клиринга.

- 8.2.2. Клиринговый центр направляет такому Участнику клиринга – некредитной организации в форме электронного документа уведомление о прекращении обязательств по сделкам не позднее Рабочего дня, следующего за датой прекращения обязательств по указанным сделкам.
- 8.2.3. Клиринговый центр в порядке, предусмотренном пунктом 8.8 Правил клиринга, рассчитывает сумму нетто-обязательства / нетто-требования Участника клиринга – некредитной организации и направляет такому Участнику клиринга в форме электронного документа уведомление о рассчитанной в соответствии с пунктом 8.8 Правил клиринга сумме нетто-обязательства или нетто-требования Участника клиринга.
- 8.2.4. Возврат денежных средств Участнику клиринга – некредитной организации осуществляется Клиринговым центром в течение 3 (трех) банковских дней после получения Клиринговым центром письма о возврате денежных средств от уполномоченного органа Участника клиринга – некредитной организации, содержащего платежные реквизиты, а также документов, подтверждающих полномочия указанного органа (если они ранее не были переданы Клиринговому центру).
- Возврат денежных средств Участнику клиринга – некредитной организации осуществляется Клиринговым центром в сумме нетто-требования Участника клиринга, рассчитанного в порядке, предусмотренном пунктом 8.8 Правил клиринга.
- 8.2.5. Клиринговый центр вправе предъявить к Участнику клиринга – некредитной организации требование о взыскании нетто-обязательства Участника клиринга, рассчитанного в порядке, предусмотренном пунктом 8.8 Правил клиринга, а также неустоек (штрафов, пеней), и комиссионных вознаграждений, подлежащих уплате в соответствии с Правилами клиринга, в общем порядке, предусмотренном законодательством о несостоятельности (банкротстве).
- 8.2.6. После назначения временной администрации или принятия арбитражным судом решения о введении в отношении Участника клиринга – некредитной организации одной из процедур банкротства и направления ему уведомления о рассчитанных нетто-обязательствах / нетто-требованиях Клиринговый центр направляет такому Участнику клиринга в форме электронного документа уведомление о прекращении действия Договора об оказании клиринговых услуг.
- 8.3. В случае отзыва (аннулирования) специального разрешения (лицензии или иного основания) компетентного органа государства учреждения Банка-нерезидента, в соответствии с которым Банк-нерезидент имеет право осуществлять банковские операции допуск к клиринговому обслуживанию Участника клиринга – Банка-нерезидента прекращается со дня отзыва (аннулирования) специального разрешения (лицензии или иного основания) компетентного органа государства учреждения Банка-нерезидента, в соответствии с которым Банк-нерезидент имеет право осуществлять банковские операции.
- 8.3.1. Подтверждением факта отзыва (аннулирования) указанного специального разрешения (лицензии или иного основания) компетентного органа государства учреждения Банка-нерезидента является письменное уведомление компетентного органа государства учреждения Банка-нерезидента, направленное Клиринговому центру (в том числе, посредством факсимильной связи) и/или размещенная Пресс-центром компетентного органа государства учреждения Банка-нерезидента на сайте

вышеуказанного компетентного органа в сети Интернет информация о принятом решении об отзыве (аннулировании) выданного Банку-нерезиденту специального разрешения (лицензии или иного основания), в соответствии с которым Банк-нерезидент имеет право осуществлять банковские операции, и/или направленное Пресс-центром компетентного органа по электронному адресу Клирингового центра соответствующее электронное сообщение.

- 8.3.2. В случае отзыва (аннулирования) специального разрешения (лицензии или иного основания) компетентного органа государства учреждения Банка-нерезидента, в соответствии с которым Банк-нерезидент имеет право осуществлять банковские операции, обязательства Банка-нерезидента по Сделкам прекращаются полностью в дату, в которую Клиринговый центр узнал об отзыве (аннулировании) компетентным органом государства учреждения Банка-нерезидента соответствующего специального разрешения (лицензии или иного основания).

Указанные обязательства прекращаются возникновением нетто-обязательств /нетто-требований Участника клиринга – Банка-нерезидента, рассчитанных в соответствии с пунктом 8.9 Правил клиринга.

- 8.3.3. Клиринговый центр направляет такому Участнику клиринга – Банку-нерезиденту в форме электронного документа уведомление о прекращении обязательств по Сделкам не позднее Рабочего дня, следующего за датой прекращения обязательств по Сделкам.
- 8.3.4. Клиринговый центр в порядке, предусмотренном пунктом 8.9 Правил клиринга, рассчитывает сумму нетто-обязательства / нетто-требования Участника клиринга – Банка-нерезидента и направляет такому Участнику клиринга в форме электронного документа уведомление о рассчитанной в соответствии с пунктом 8.9 Правил клиринга сумме нетто-обязательства или нетто-требования Участника клиринга.
- 8.3.5. Возврат денежных средств Участнику клиринга – Банку-нерезиденту осуществляется Клиринговым центром в течение 3 (трех) банковских дней после получения Клиринговым центром письма о возврате денежных средств от уполномоченного (в соответствии с национальным законодательством страны учреждения Банка-нерезидента) органа Банка-нерезидента, содержащего платежные реквизиты, в сумме нетто-требования в российских рублях Участника клиринга, рассчитанного в порядке, предусмотренном пунктом 8.9 Правил клиринга.
- 8.3.6. Клиринговый центр вправе предъявить Участнику клиринга - Банку-нерезиденту требование об уплате денежных средств в сумме нетто-обязательства Участника клиринга в российских рублях, рассчитанного в соответствии с пунктом 8.9 Правил клиринга, в судебном порядке.
- 8.3.7. После возврата денежных средств Участнику клиринга – Банку-нерезиденту Клиринговый центр направляет такому Участнику клиринга в форме электронного документа уведомление о прекращении действия Договора об оказании клиринговых услуг.
- 8.4. В случае прекращения Международного соглашения для Российской Федерации либо со дня прекращения Международного соглашения для государства - стороны Международного соглашения, являющегося государством учреждения Участника-клиринга – Банка-нерезидента, допуск к клиринговому обслуживанию такого Участника клиринга – Банка-нерезидента прекращается со дня прекращения Международного соглашения для Российской Федерации либо со дня прекращения Международного соглашения для государства - стороны Международного

соглашения, являющегося государством учреждения такого Участника-клиринга – Банка-нерезидента.

- 8.4.1. После прекращения обязательств по Сделкам, заключенным данным Участником клиринга до момента прекращения допуска к клиринговому обслуживанию Участника клиринга, Клиринговый центр в течение 3 (трех) банковских дней после получения письма о возврате денежных средств от уполномоченного органа Участника клиринга – Банка-нерезидента, содержащего платежные реквизиты, осуществляет возврат денежных средств Участнику клиринга, учитываемых на счетах Клирингового центра, и направляет такому Участнику клиринга в форме электронного документа уведомление о прекращении действия Договора об оказании клиринговых услуг.
- 8.5. В случае прекращения международного договора, в соответствии с которым учреждена Международная организация, для Российской Федерации либо со дня принятия решения уполномоченными лицами сторон указанного международного договора о прекращении деятельности Международной организации, допуск к клиринговому обслуживанию Международной организации прекращается со дня прекращения международного договора, в соответствии с которым такая Международная организация учреждена, для Российской Федерации либо со дня принятия решения уполномоченными лицами сторон указанного международного договора о прекращении деятельности Международной организации.
- 8.5.1. После прекращения обязательств по Сделкам, заключенным данным Участником клиринга до момента прекращения допуска к клиринговому обслуживанию Участника клиринга, Клиринговый центр в течение 3 (трех) банковских дней после получения письма о возврате денежных средств от уполномоченного органа Международной организации, содержащего платежные реквизиты, осуществляет возврат денежных средств Участнику клиринга – Международной организации и направляет такому Участнику клиринга – Международной организации в форме электронного документа уведомление о прекращении действия Договора об оказании клиринговых услуг.
- 8.6. В случае принятия федерального закона о ликвидации Государственной корпорации, допуск к клиринговому обслуживанию Государственной корпорации прекращается.
- 8.6.1. Если иное не предусмотрено федеральным законом о ликвидации Государственной корпорации, после прекращения обязательств по Сделкам, заключенным данным Участником клиринга до момента прекращения допуска к клиринговому обслуживанию Участника клиринга, Клиринговый центр в течение 3 (трех) банковских дней после получения письма о возврате денежных средств от уполномоченного органа Государственной корпорации, содержащего платежные реквизиты, осуществляет возврат денежных средств Участнику клиринга – Государственной корпорации и направляет такому Участнику клиринга – Государственной корпорации в форме электронного документа уведомление о прекращении действия Договора об оказании клиринговых услуг.
- 8.7. В случае принятия арбитражным судом решения о признании Участника клиринга – кредитной организации несостоятельным (банкротом) Клиринговый центр рассчитывает размер нетто-обязательства / нетто-требования Участника клиринга в российских рублях как сумму с учетом знака рассчитанных в соответствующих валютах:
- а) разности суммы абсолютных величин Нетто-обязательств в соответствующей

валюте Участников клиринга по Сделкам, заключенным на основании подтверждений УКО, сформированных Клиринговым центром в соответствии с пунктом 19.24 Правил клиринга, и суммы абсолютных величин Нетто-обязательств в соответствующей валюте Участника клиринга, рассчитанных на конец дня, предшествующего дате отзыва (аннулирования) у Участника клиринга лицензии на осуществление банковских операций, и

- б) разности суммы Нетто-требований в соответствующей валюте Участника клиринга, рассчитанных на конец дня, предшествующего дате отзыва (аннулирования) у Участника клиринга лицензии на осуществление банковских операций, и суммы Нетто-требований в соответствующей валюте Участников клиринга по сделкам, заключенным на основании подтверждений УКО, сформированных Клиринговым центром в соответствии с пунктом 19.24 Правил клиринга, и
- в) Обеспечения Участника клиринга в соответствующей валюте (учитывается со знаком «плюс») и;
- г) значения (с учетом знака) обязательства / требования Участника клиринга в российских рублях по возврату Компенсационных взносов, рассчитанного на дату, предшествующую дате отзыва (аннулирования) у Участника клиринга лицензии на осуществление банковских операций, и
- д) Задолженности по сделкам и/или Задолженности по компенсационным взносам (со знаком «минус») Участника клиринга в российских рублях, возникшей до даты отзыва (аннулирования) у Участника клиринга указанной лицензии.

При этом значения в иностранной валюте, рассчитанные в соответствии с подпунктами а), б), г) настоящего пункта, и Обеспечение в иностранной валюте пересчитывается в российские рубли по курсу, установленному Банком России на день отзыва у Участника клиринга лицензии на осуществление банковских операций. Если величина, рассчитанная в соответствии с настоящим пунктом Правил клиринга, отрицательная, это означает наличие нетто-обязательства Участника клиринга по отношению к Клиринговому центру, если положительная – наличие нетто-требования Участника клиринга по отношению к Клиринговому центру.

- 8.8. В случае принятия арбитражным судом решения о ликвидации Участника клиринга – кредитной организации или в случае назначения временной администрации или принятия арбитражным судом решения о введении в отношении Участника клиринга - некредитной организацией одной из процедур банкротства (за исключением конкурсного управления), Клиринговый центр рассчитывает размер нетто-обязательства Участника клиринга в российских рублях в порядке, предусмотренном пунктом 8.7 Правил клиринга, но с учетом параметров Сделок, заключенных Участником клиринга до момента отзыва (аннулирования) у него лицензии на осуществление банковских операций в день отзыва (аннулирования) указанной лицензии, а также неустоек (штрафов, пеней) и комиссионных вознаграждений, подлежащих уплате Участником клиринга в соответствии с Правилами клиринга.
- 8.9. В случае отзыва (аннулирования) специального разрешения (лицензии или иного основания) компетентного органа государства учреждения Банка-нерезидента, в соответствии с которым Банк-нерезидент имеет право осуществлять банковские операции, Клиринговый центр рассчитывает размер нетто-обязательства / нетто-требования Участника клиринга в соответствующей валюте как сумму с учетом знака рассчитанных в соответствующих валютах:

- а) разности суммы абсолютных величин Нетто-обязательств в соответствующей валюте Участников клиринга по Сделкам, заключенным на основании подтверждений УКО, сформированных Клиринговым центром в соответствии с пунктом 19.24 Правил клиринга, и суммы абсолютных величин Нетто-обязательств в соответствующей валюте Участника клиринга, рассчитанных на конец дня, в который Клиринговый центр узнал об отзыве (аннулировании) у Участника клиринга специального разрешения (лицензии или иного основания) компетентного органа государства учреждения Банка-нерезидента, и
- б) разности суммы Нетто-требований в соответствующей валюте Участника клиринга, рассчитанных на конец дня, в который Клиринговый центр узнал об отзыве (аннулировании) у Участника клиринга специального разрешения (лицензии или иного основания) компетентного органа государства учреждения Банка-нерезидента, в соответствии с которым Банк-нерезидент имеет право осуществлять банковские операции, и суммы Нетто-требований в соответствующей валюте Участников клиринга по сделкам, заключенным на основании подтверждений УКО, сформированных Клиринговым центром в соответствии с пунктом 19.24 Правил клиринга, и
- в) Обеспечения Участника клиринга в соответствующей валюте (учитывается со знаком «плюс») и;
- г) взноса Участника клиринга в Фонд (учитывается со знаком «плюс») и;
- д) значения (с учетом знака) обязательства / требования Участника клиринга в российских рублях по возврату Компенсационных взносов, рассчитанного на конец дня, в который Клиринговый центр узнал об отзыве (аннулировании) у Участника клиринга специального разрешения (лицензии или иного основания) компетентного органа государства учреждения Банка-нерезидента, в соответствии с которым Банк-нерезидент имеет право осуществлять банковские операции, и
- е) Задолженности (со знаком «минус») Участника клиринга в российских рублях, возникшей до дня, в который Клиринговый центр узнал об отзыве (аннулировании) у Участника клиринга специального разрешения (лицензии или иного основания) компетентного органа государства учреждения Банка-нерезидента, в соответствии с которым Банк-нерезидент имеет право осуществлять банковские операции, и/или в указанный день.

При этом значения в иностранной валюте, рассчитанные в соответствии с подпунктами а), б), д) настоящего пункта, и Обеспечение в иностранной валюте пересчитывается в российские рубли по Центральному курсу, рассчитанному Клиринговым центром в ходе клиринговой сессии Рабочего дня, предшествующего дню расчета указанной суммы денежных средств.

- 8.10. В случае отзыва (аннулирования) лицензии на осуществление банковских операций у Клирингового центра, обязательства по Сделкам, заключенным до даты отзыва (аннулирования) такой лицензии, прекращаются полностью на дату, предшествующую дате отзыва (аннулирования) лицензии на осуществление банковских операций у Клирингового центра.

Указанные обязательства прекращаются возникновением нетто-обязательства / нетто-требования Клирингового центра, рассчитанного в соответствии с пунктом 8.11 Правил клиринга, если Клиринговый центр решением суда признан несостоятельным (банкротом), или рассчитанного в соответствии с пунктом 8.12 Правил клиринга, если

в отношении Клирингового центра принято решение суда о его ликвидации. Такое нетто-обязательство Клирингового центра подлежит исполнению после вступления в силу соответствующего решения арбитражного суда.

- 8.10.1. В случае отзыва (аннулирования) лицензии на осуществление банковских операций у Клирингового центра, обязательства по Сделкам, заключенным в дату отзыва (аннулирования) такой лицензии, являются недействительными.

Участник клиринга вправе предъявить к Клиринговому центру требование о взыскании убытков, связанных с недействительностью указанных Сделок, а также неустоек (штрафов, пеней), подлежащих уплате в соответствии с Правилами клиринга, в общем порядке, предусмотренном законодательством о несостоятельности (банкротстве).

- 8.11. В случае принятия арбитражным судом решения о признании Клирингового центра несостоятельным (банкротом) размер нетто-обязательства / нетто-требования Клирингового центра в российских рублях в отношении каждого Участника клиринга рассчитывается как сумма с учетом знака по всем Регистрационным и Расчетным кодам Участника клиринга и всем Датам исполнения:

- а) суммы с учетом знака Нетто-обязательства Участника клиринга в российских рублях, рассчитанного на конец дня, предшествующего дате отзыва (аннулирования) у Клирингового центра лицензии на осуществление банковских операций, и требования Участника клиринга в российских рублях по оплате иностранной валюты, которое возникло бы в случае заключения между Участником клиринга и Клиринговым центром сделки по продаже Участником клиринга иностранной валюты в сумме, равной Нетто-требованию Участника клиринга в данной иностранной валюте, рассчитанному на конец дня, предшествующего дате отзыва (аннулирования) у Клирингового центра лицензии на осуществление банковских операций, по курсу, установленному Банком России на день отзыва у Клирингового центра лицензии на осуществление банковских операций, в случае если на конец дня, предшествующего дате отзыва (аннулирования) у Клирингового центра лицензии на осуществление банковских операций, у Участника клиринга учитывалось Нетто-требование в данной иностранной валюте, и/или;
- е) суммы с учетом знака Нетто-требования Участника клиринга в российских рублях, рассчитанного на конец дня, предшествующего дате отзыва (аннулирования) у Клирингового центра лицензии на осуществление банковских операций, и обязательства Участника клиринга в российских рублях по оплате иностранной валюты, которое возникло бы в случае заключения между Участником клиринга и Клиринговым центром сделки по покупке Участником клиринга иностранной валюты в сумме, равной Нетто-обязательству Участника клиринга в данной иностранной валюте, рассчитанному на конец дня, предшествующего дате отзыва (аннулирования) у Клирингового центра лицензии на осуществление банковских операций, по курсу, установленному Банком России на день отзыва у Клирингового центра лицензии на осуществление банковских операций, в случае если на конец дня, предшествующего дате отзыва (аннулирования) у Клирингового центра лицензии на осуществление банковских операций, у Участника клиринга учитывалось Нетто-обязательство в данной иностранной валюте.
- ж) Обеспечения Участника клиринга в российских рублях (учитывается со знаком «плюс»);

- з) Обеспечения Участника клиринга в иностранной валюте, пересчитанного в российские рубли по курсу, установленному Банком России на день отзыва (аннулирования) у Клирингового центра лицензии на осуществление банковских операций (учитывается со знаком «плюс»);
- и) неисполненных Маржинальных требований, возникших до даты отзыва (аннулирования) у Клирингового центра лицензии на осуществление банковских операций (учитываются со знаком «минус»);
- к) вноса Участника клиринга в Фонд (учитывается со знаком «плюс»);
- л) значения (с учетом знака) обязательства / требования Участника клиринга в российских рублях по возврату Компенсационных взносов по Сделкам с частичным обеспечением, рассчитанного на дату, предшествующую дате отзыва (аннулирования) у Клирингового центра лицензии на осуществление банковских операций, и
- м) Задолженности и/или Задолженности по компенсационным взносам (со знаком «минус») Участника клиринга в российских рублях, возникшей до даты отзыва (аннулирования) у Клирингового центра лицензии на осуществление банковских операций.

Если величина, рассчитанная в соответствии с настоящим пунктом Правил клиринга, отрицательная, это означает наличие нетто-требования Клирингового центра по отношению к Участнику клиринга, если положительная – наличие нетто-обязательства Клирингового центра по отношению к Участнику клиринга.

8.12. В случае принятия арбитражным судом решения о ликвидации Клирингового центра размер нетто-обязательства / нетто-требования Клирингового центра в российских рублях в отношении Участника клиринга рассчитывается в порядке, предусмотренном пунктом 8.11 Правил клиринга, но с учетом неустоек (штрафов, пеней), комиссионных вознаграждений, подлежащих уплате в соответствии с Правилами клиринга.

8.13. Информация о размере нетто-обязательства / нетто-требования Клирингового центра в российских рублях в отношении Участника клиринга, определенных в соответствии с пунктами 8.11, 8.12 Правил клиринга направляется Клиринговым центром Участнику клиринга в форме электронного документа.

9. Конфиденциальность и персональные данные

9.1. Участник клиринга и Клиринговый центр обязуются рассматривать содержание Договора об оказании клиринговых услуг и условия заключенных Сделок как конфиденциальную информацию и не будут раскрывать ее третьим лицам (за исключением аудиторов Участника клиринга или Клирингового центра, уполномоченных государственных органов, Клиентов Участников клиринга, в интересах которых заключены указанные сделки, а также случаев раскрытия информации в соответствии с требованиями действующего законодательства Российской Федерации), если иное не будет специально согласовано между Участником клиринга и Клиринговым центром.

9.2. Любые документы, предоставленные и подготовленные Участником клиринга и/или Клиринговым центром для исполнения Договора об оказании клиринговых услуг и Сделок, заключенных в рамках Договора об оказании клиринговых услуг,

рассматриваются как конфиденциальные.

- 9.3. Положения, содержащиеся в пунктах 9.4-9.5 Правил клиринга, не распространяются на информацию, которая является общедоступной.
- 9.4. Участник клиринга / юридическое лицо подтверждают, что все персональные данные, упоминаемые в Правилах клиринга, Договоре об оказании клиринговых услуг, а также передаваемые Участником клиринга / юридическим лицом и Клиринговым центром друг другу, в случае если это требуется в целях исполнения Договора об оказании клиринговых услуг, достоверны и получены от субъекта персональных данных в законном порядке и передаются с согласия субъекта персональных данных, в случае если такое согласие предусмотрено законодательством Российской Федерации.
- 9.5. Участник клиринга / юридическое лицо и/или Клиринговый центр обязуются не допускать распространения указанных персональных данных без согласия субъекта персональных данных или наличия иного законного основания, обеспечивать конфиденциальность персональных данных и безопасность персональных данных при их обработке в случаях, предусмотренных Правилами клиринга и законодательством Российской Федерации.

10. Порядок использования Аналога собственноручной подписи

- 10.1. Аналог собственноручной подписи используется при подаче (направлении) с использованием Клиринговой системы электронных сообщений, предусмотренных Правилами клиринга. Электронное сообщение, подписанное АСП, признается электронным документом, равнозначным документу на бумажном носителе, подписанному уполномоченным лицом Участника клиринга / Клирингового центра.
- 10.2. Клиринговый центр обеспечивает защищенность и целостность электронных сообщений Участника клиринга и Клирингового центра в результате применения комплекса организационных и технических мер.
- 10.3. Электронное сообщение считается подписанным АСП с момента отправки Участником клиринга / Клиринговым центром в Клиринговую систему такого электронного сообщения при условии успешного прохождения Участником клиринга / Клиринговым центром процедуры аутентификации в порядке, предусмотренном настоящим разделом.
- 10.4. Присвоение Клирингового идентификатора Участнику клиринга или Клиринговому центру осуществляется Клиринговым центром.
- Включение информации о Клиринговом идентификаторе Участника клиринга в состав ежедневного Отчета о Клиринговых идентификаторах, считается уведомлением о присвоении Клирингового идентификатора Участнику клиринга.
- Форма Отчета о Клиринговых идентификаторах приведена в приложении № 35 к Правилам клиринга.
- Сведения о присвоенных Клиринговых идентификаторах относятся к конфиденциальным и не подлежат передаче третьим лицам, за исключением Технического центра, которому такие сведения доступны в связи с проведением

процедуры аутентификации. Участник клиринга и Клиринговый центр обеспечивают соблюдение требований о конфиденциальности и несут риск последствий, связанных с нарушением таких требований.

- 10.5. Процедура аутентификации осуществляется Техническим центром с использованием Клиринговой системы при осуществлении технического доступа Участника клиринга или Клирингового центра в Клиринговую систему через удаленное рабочее место Участника клиринга или Клирингового центра путем сопоставления введенных Клирингового идентификатора и пароля соответствующим Клиринговому идентификатору и паролю Участника клиринга / Клирингового центра, информация о которых содержится в базе данных Клиринговой системы.

В случае успешного прохождения процедуры аутентификации Участник клиринга / Клиринговый центр получает возможность осуществления операций в Клиринговой системе.

- 10.6. Участник клиринга и Клиринговый центр соглашаются с тем, что Клиринговым центром могут быть изготовлены (распечатаны) копии подписанных АСП электронных сообщений на бумажном носителе, которые удостоверяются подписью уполномоченного лица Клирингового центра и являются бесспорным доказательством факта направления электронного сообщения с использованием Клиринговой системы, а также подтверждают соответствие электронного сообщения содержанию копии электронного сообщения, изготовленного (распечатанного) на бумажном носителе.

- 10.7. По письменному запросу Участника клиринга Клиринговый центр предоставляет Участнику клиринга копию направленного Участником (Участнику) клиринга электронного сообщения, изготовленного (распечатанного) на бумажном носителе.

Запрос Участника клиринга должен содержать дату, на которую, либо период времени, за который предоставляются электронные сообщения.

- 10.8. Участник клиринга и Клиринговый центр соглашаются с тем, что все возникшие конфликтные ситуации, связанные с использованием АСП, будут стремиться решить в досудебном порядке.

- 10.9. В случае возникновения конфликтных ситуаций в связи с использованием АСП проводится техническая экспертиза в соответствии с приложением 34 к Правилам клиринга.

- 10.10. В случае, если по результатам технической экспертизы, проведенной в соответствии с приложением 34 к Правилам клиринга, конфликтная ситуация остается неурегулированной, то такая конфликтная ситуация подлежит рассмотрению в порядке, предусмотренном разделом 23 Правил клиринга.

11. Клиринговые регистры

- 11.1. Клиринговый центр осуществляет учет информации, предусмотренной настоящим разделом Правил клиринга, на клиринговых регистрах. Клиринговые регистры ведутся Клиринговым центром в Клиринговой системе.

- 11.2. Клиринговый центр учитывает:

- Единый лимит каждого Участника клиринга;
- Лимит, обеспеченный средствами фонда, каждого Участника клиринга для которого указанный лимит установлен;
- Торговый лимит каждого Участника клиринга, для которого указанный Торговый лимит установлен;
- обязательства и требования Участника клиринга по каждой Сделке;
- обязательства Участников клиринга и Клирингового центра по возврату Компенсационных взносов;
- Нетто-обязательство / Нетто-требование Участника клиринга в каждой валюте и с каждой Датой исполнения;
- Итоговое нетто-обязательство / Итоговое нетто-требование Участника клиринга в каждой валюте;
- Обеспечение Участника клиринга в каждой валюте.

Указанный учет осуществляется Клиринговым центром в разрезе Расчетных кодов Участника клиринга.

- 11.3. Для каждого Участника клиринга Клиринговый центр также учитывает его взнос в Фонд.
- 11.4. Порядок определения Единого лимита Участника клиринга приведен в разделе 12 Правил клиринга.
- 11.5. Значение Нетто-обязательства / Нетто-требования Участника клиринга рассчитывается после заключения каждой Сделки.
- 11.6. Порядок определения Итоговых нетто-обязательств / Итоговых нетто-требований Участников клиринга приведен в разделе 16 Правил клиринга.
- 11.7. Порядок перечисления Участниками клиринга денежных средств на счета Клирингового центра и порядок их учета в качестве Обеспечения определен разделом 15 Правил клиринга.

12. Единый лимит и риск-параметры

- 12.1. Единый лимит рассчитывается Клиринговым центром при изменении размера Обеспечения Участника клиринга, при подаче Участником клиринга заявок, заключении им Сделок, исполнении / прекращении обязательств по Сделкам, изменении риск-параметров.
- 12.2. Единый лимит Участника клиринга используется для проверки возможности подачи Участником клиринга заявок, исполнения / прекращения обязательств по Сделкам, возврата Участнику клиринга денежных средств со счетов Клирингового центра, а также выполнения иных операций, предусмотренных Правилами клиринга. Указанная проверка осуществляется, исходя из анализа изменения значения Единого лимита Участника клиринга до и после проведения операции.
- 12.3. Единый лимит Участника клиринга рассчитывается с учетом:

- Обеспечения Участника клиринга в валютах, являющихся валютой лота или сопряженной валютой для Сделок с частичным обеспечением;
- Лимита, обеспеченного средствами Фонда (для Участников клиринга, являющихся участниками Фонда);
- Нетто-требований Участника клиринга в валютах, являющихся валютой лота или сопряженной валютой для Сделок с частичным обеспечением;
- Нетто-обязательств Участника клиринга в валютах, являющихся валютой лота или сопряженной валютой для Сделок с частичным обеспечением;
- Дополнительного обеспечения, рассчитанного для Участника клиринга;
- Задолженности по сделкам Участника клиринга перед Клиринговым центром в российских рублях;
- Задолженности по комиссиям Участника клиринга перед Клиринговым центром в российских рублях;
- Задолженности по компенсационным взносам Участника клиринга перед Клиринговым центром в российских рублях;
- корректировки Единого лимита с учетом Индикативных курсов сделок своп.

12.4. В случае если для Участника клиринга установлен Торговый лимит, размер Обеспечения Участника клиринга в российских рублях и стоимость в российских рублях Обеспечения Участника клиринга в иностранной валюте, учитываемая при расчете Единого лимита Участника клиринга, ограничивается величиной Торгового лимита такого Участника клиринга, который устанавливается в следующем порядке:

12.4.1. Торговый лимит Участника клиринга устанавливается на основании Запроса об установлении Торгового лимита, направляемого Участником клиринга в Клиринговый центр, или на основании решения Клирингового центра, принимаемого в связи с наличием фактов ухудшения финансового состояния Участника клиринга и/или информации, дающей основания считать возможным ухудшение финансового состояния Участника клиринга.

12.4.2. Запрос об установлении Торгового лимита направляется Клиринговому центру в электронном виде с использованием Клиринговой системы или на бумажном носителе по форме, установленной приложением № 21 к Правилам клиринга, или в форме электронного документа.

Запрос об установлении Торгового лимита исполняется Клиринговым центром, начиная с первого Торгового дня, следующего за датой предоставления указанного запроса.

Запрос об установлении Торгового лимита действует до его отмены Участником клиринга.

12.4.3. Торговый лимит Участника клиринга на основании решения Клирингового центра устанавливается, начиная с первого Торгового дня, следующего за датой принятия указанного решения, если иное не указано в решении Клирингового центра.

Торговый лимит Участника клиринга, установленный на основании решения Клирингового центра, действует до отмены указанного решения.

12.4.4. В случае установления Торгового лимита Участника клиринга на основании решения Клирингового центра, Запросы об установлении Торгового лимита Участника клиринга не исполняются.

12.5. Порядок определения Лимита, обеспеченного средствами фонда, для Участников клиринга, размер вноса в Фонд которых соответствует установленному Клиринговым центром размеру вноса в Фонд, устанавливается Методикой лимитирования операций на валютном рынке.

Клиринговый центр уведомляет Участника клиринга об установленном ему Лимите, обеспеченном средствами фонда, в течение двух рабочих дней со дня принятия такого решения. Данное уведомление направляется Участнику клиринга при первоначальном установлении Лимита, обеспеченного средствами фонда, и при его изменении.

12.5.1. Лимит, обеспеченный средствами фонда, установленный Участнику клиринга Клиринговым центром, увеличивает Единый лимит по основному Расчетному коду основного Регистрационного кода Участника клиринга.

12.5.2. Участник клиринга может перераспределить Лимит, обеспеченный средствами фонда, между своими Регистрационными и Расчетными кодами, подав в Клиринговый центр Заявление о распределении Лимита, обеспеченного средствами фонда, в электронном виде с использованием Клиринговой системы, или на бумажном носителе по форме, установленной приложением № 20 к Правилам клиринга, или в форме электронного документа.

12.5.3. В Заявлении о распределении Лимита, обеспеченного средствами фонда, указывается величина (в рублях, с учетом знака), на которую должно быть изменено значения Лимита, обеспеченного средствами фонда, по указанному в данном заявлении Расчетному коду. Положительная величина, указанная в данном заявлении, означает, что Лимит, обеспеченный средствами фонда, по Расчетному коду должен быть увеличен, отрицательная - уменьшен.

В Заявлении о распределении Лимита, обеспеченного средствами фонда, должен быть указан один Расчетный код, Лимит, обеспеченный средствами фонда, по которому должен быть уменьшен, и может быть указано более одного Расчетного кода, Лимит, обеспеченный средствами фонда, по которым должен быть увеличен.

12.5.4. Заявление о распределении Лимита, обеспеченного средствами фонда, не принимается Клиринговым центром к исполнению, если не соблюден порядок заполнения данного заявления, указанный в подпункте 12.5.3 Правил клиринга, или не выполняется хотя бы одно из перечисленных ниже условий:

- сумма (с учетом знака) величин изменения Лимита, обеспеченного средствами фонда, указанных в данном заявлении, равна нулю;
- значение Лимита, обеспеченного средствами фонда, по каждому из Расчетных кодов Участника клиринга в результате исполнении данного заявления останется неотрицательным;
- Единый лимит Участника клиринга по любому Расчетному коду в результате исполнения данного заявления останется неотрицательным, или отрицательный Единый лимит Участника клиринга по любому Расчетному коду в результате исполнения данного заявления увеличится.

12.5.5. При установлении Участнику клиринга Клиринговым центром нового Лимита, обеспеченного средствами фонда, разница между значениями нового и установленного ранее Лимита, обеспеченного средствами фонда, увеличивает (уменьшает) Лимит, обеспеченный средствами фонда, установленный по основному Расчетному коду основного Регистрационного кода Участника клиринга.

- 12.5.6. Если новый Лимит, обеспеченный средствами фонда, меньше, чем ранее установленный Лимит, обеспеченный средствами фонда, и разница между значением ранее установленного Лимита, обеспеченного средствами фонда, и значением нового Лимита, обеспеченного средствами фонда, больше, чем Лимит, обеспеченный средствами фонда, установленный по основному Расчетному коду основного Регистрационного кода Участника клиринга, остаток указанной разницы уменьшает Лимиты, обеспеченные средствами фонда, установленные по иным Регистрационным и Расчетным кодам Участника клиринга, в следующей последовательности:
- в первую очередь, уменьшаются Лимиты, обеспеченные средствами фонда, установленные по дополнительным Расчетным кодам основного Регистрационного кода Участника клиринга в порядке возрастания значений дополнительных Расчетных кодов;
 - в следующую очередь, уменьшаются Лимиты, обеспеченные средствами фонда, установленные по Расчетным кодам дополнительных Регистрационных кодов Участника клиринга. Выбор дополнительных Регистрационных кодов осуществляется в порядке возрастания значений Регистрационных кодов. Выбор Расчетных кодов в рамках дополнительных Регистрационных кодов осуществляется в порядке, аналогичном порядку, установленному для выбора Расчетных кодов в рамках основного Регистрационного кода.
- 12.5.7. При установлении Участнику клиринга Клиринговым центром нового Лимита, обеспеченного средствами фонда, у Участника клиринга сохраняется возможность его перераспределения между своими Регистрационными и Расчетными кодами в порядке, определенном настоящим пунктом Правил клиринга.
- 12.6. Единый лимит Участника клиринга в ходе торгов рассчитывается Клиринговым центром с учетом:
- зарегистрированных в ТС заявок на заключение Сделок с частичным обеспечением, поданных Участником клиринга;
 - зарегистрированных в ТС заявок на покупку на заключение Сделок с полным обеспечением, поданных Участником клиринга.
- 12.7. Базовыми риск-параметрами, используемыми Клиринговым центром для контроля и управления рисками, являются:
- Центральный курс;
 - Верхняя и Нижняя границы ценового коридора;
 - Верхняя и Нижняя границы диапазона оценки рисков;
 - центральное значение Индикативного курса сделок своп;
 - верхнее и нижнее значения Индикативного курса сделок своп.
- Помимо базовых риск-параметров Клиринговым центром используются дополнительные риск-параметры, приведенные в Методике определения риск-параметров валютного рынка.
- 12.8. Клиринговый центр вправе установить индивидуальные Верхнюю и Нижнюю границу диапазона оценки рисков для одного или нескольких Участников клиринга в следующих случаях:
- в случае необходимости предотвратить нарушение Клиринговым центром

обязательных нормативов Банка России;

- при превышении объема обязательств Участника клиринга определенного, установленного Клиринговым центром, значения.

12.9. Расчет и изменение риск-параметров осуществляется Клиринговым центром по состоянию на 19:00 по московскому времени.

Клиринговый центр может принять решение об изменении риск-параметров до начала и в ходе торгов.

Изменения риск-параметров в ходе торгов, проводимых после 19:00 по московскому времени, не производится.

Порядок расчета и изменения Центральных курсов установлен Методикой определения Центрального курса, являющейся приложением № 1 к Правилам клиринга.

Порядок расчета и изменения иных риск-параметров установлен Методикой определения риск-параметров валютного рынка.

12.10. Единый лимит Участника клиринга рассчитывается Клиринговым центром исходя из оценки в российских рублях максимально возможного в течение двух торговых дней уменьшения общей стоимости:

- Обеспечения Участника клиринга;
- Задолженности по сделкам Участника клиринга перед Клиринговым центром;
- Задолженности по комиссиям Участника клиринга перед Клиринговым центром;
- Задолженности по компенсационным взносам Участника клиринга перед Клиринговым центром;
- Нетто-обязательств и Нетто-требований Участников клиринга;
- обязательств и требований по Сделкам, которые могут быть заключены на основании зарегистрированных в ТС заявок, направленных на заключение Сделок с частичным обеспечением,

в связи с изменением Центральных курсов и/или изменением процентных ставок по сделкам своп.

При расчете Единого лимита Участника клиринга обязательства по Сделкам, которые могут быть заключены на основании зарегистрированных в ТС заявок, Нетто-обязательства и Задолженности учитываются со знаком «минус», требования по Сделкам, которые могут быть заключены на основании зарегистрированных в ТС заявок, Нетто-требования и Обеспечение– со знаком «плюс».

Для целей расчета Единого лимита Участника клиринга Нетто-обязательства и Нетто-требования Участника клиринга в одной валюте с разными Датами исполнения складываются с учетом знака.

Указанная оценка проводится с использованием Верхней и Нижней границ диапазона оценки рисков.

Рассчитанный в соответствии с настоящим пунктом Правил клиринга Единый лимит корректируется (складывается с учетом знака) с итоговой корректировкой Единого лимита с учетом Индикативных курсов сделок своп, рассчитанной как сумма с учетом знака корректировок Единого лимита с учетом Индикативных курсов сделок своп по каждой валюте и каждой Дате исполнения, отстоящей от текущей даты более, чем на

1 (один) Расчетный день.

13. Порядок взаимодействия с Администратором при подаче заявок и заключении Сделок

- 13.1. Немедленно после того, как информация о поданной Участником клиринга заявке на продажу, направленной на заключение Сделки с полным обеспечением, стала доступной Клиринговому центру посредством ПТК ТЦ, Клиринговый центр:
- 13.1.1. проверяет, что значение цены, указанной в заявке, больше либо равно Нижней границе ценового коридора и меньше либо равно Верхней границе ценового коридора, установленных Клиринговым центром (в случае если заявка подана в рамках Торговой сессии ЕТС);
- 13.1.2. рассчитывает сумму денежных средств Участника клиринга в валюте лота, которая может быть использована для заключения Сделки с полным обеспечением, с учетом:
- Обеспечения Участника клиринга в валюте лота;
 - Нетто-обязательств и/или Нетто-требований Участника клиринга в валюте лота;
 - всех поданных Участником клиринга и зарегистрированных в ТС заявок на продажу, направленных на заключение сделок по покупке и продаже иностранной валюты, являющейся валютой лота в поданной заявке;
- 13.1.3. проверяет, что значение суммы денежных средств Участника клиринга, рассчитанной в соответствии с подпунктом 13.1.2 Правил клиринга, больше либо равно объему поданной заявки в валюте лота.
- 13.2. Немедленно после проведения Клиринговым центром проверок, указанных в подпунктах 13.1.1, 13.1.3 Правил клиринга, информация об их результате становится доступной Администратору посредством ПТК ТЦ: в случае положительного результата всех указанных проверок – информация о возможности регистрации в ТС заявки, в случае отрицательного результата хотя бы одной из указанных проверок – информация о невозможности регистрации в ТС заявки.
- 13.3. Немедленно после того, как информация о поданной Участником клиринга заявке на покупку, направленной на заключение Сделки с полным обеспечением, стала доступной Клиринговому центру посредством ПТК ТЦ, Клиринговый центр:
- 13.3.1. проверяет, что значение цены, указанной в заявке, больше либо равно Нижней границе ценового коридора и меньше либо равно Верхней границе ценового коридора, установленных Клиринговым центром (в случае если заявка подана в рамках Торговой сессии ЕТС);
- 13.3.2. рассчитывает сумму денежных средств Участников клиринга в российских рублях, которая может быть использована для заключения Сделки с полным обеспечением, с учетом:
- Обеспечения Участника клиринга в российских рублях;
 - Нетто-обязательств и/или Нетто-требований Участника клиринга в российских рублях;
 - всех поданных Участником клиринга и зарегистрированных в ТС заявок на покупку, направленных на заключение сделок по покупке иностранной валюты

за российские рубли;

- 13.3.3. проверяет, что значение суммы денежных средств Участника клиринга, рассчитанной в соответствии с подпунктом 13.3.2 Правил клиринга, больше либо равно объему поданной заявки в российских рублях;
- 13.3.4. проверяет, что текущий Единый лимит Участника клиринга – неотрицательный;
- 13.3.5. рассчитывает значение Единого лимита Участника клиринга без учета (за вычетом) суммы, равной объему поданной заявки в российских рублях;
- 13.3.6. проверяет, что значение Единого лимита Участника клиринга, рассчитанное в соответствии с подпунктом 13.3.5 Правил клиринга, не стало отрицательным.
- 13.4. Немедленно после проведения Клиринговым центром проверок, указанных в подпунктах 13.3.1, 13.3.3, 13.3.4, 13.3.6 Правил клиринга, информация об их результате становится доступной Администратору посредством ПТК ТЦ: в случае положительного результата всех указанных проверок – информация о возможности регистрации в ТС заявки, в случае отрицательного результата хотя бы одной из указанных проверок – информация о невозможности регистрации в ТС заявки.
 - 13.4.1. В случае возможности регистрации в ТС заявки, Клиринговый центр начинает учитывать значение Единого лимита Участника клиринга, рассчитанное в соответствии с подпунктом 13.3.5 Правил клиринга, в качестве нового значения Единого лимита Участника клиринга.
 - 13.4.2. В случае невозможности регистрации в ТС заявки, Клиринговый центр не изменяет учитываемое значение Единого лимита Участника клиринга.
- 13.5. Немедленно после того, как информация о поданной Участником клиринга заявке на покупку или заявке на продажу, направленной на заключение Сделки с частичным обеспечением, стала доступной Клиринговому центру посредством ПТК ТЦ, Клиринговый центр:
 - 13.5.1. проверяет, что значение цены, указанной в заявке, больше либо равно Нижней границе ценового коридора и меньше либо равно Верхней границе ценового коридора, установленных Клиринговым центром для инструмента, по которому подана заявка (в случае если заявка подана в рамках Торговой сессии ЕТС);
 - 13.5.2. рассчитывает значение Единого лимита Участника клиринга с учетом поданной заявки;
 - 13.5.3. проверяет, что значение Единого лимита Участника клиринга, рассчитанное в соответствии с подпунктом 13.5.2 Правил клиринга, не стало отрицательным, или, если Единый лимит Участника клиринга был отрицательным до момента подачи заявки, - проверку того, что Единый лимит Участника клиринга, рассчитанный в соответствии с подпунктом 13.5.2 Правил клиринга, не стал меньше, чем Единый лимит Участника клиринга, рассчитанный до момента подачи заявки.
- 13.6. Немедленно после проведения Клиринговым центром проверок, указанных в подпунктах 13.5.1, 13.5.3 Правил клиринга, информация об их результате становится доступной Администратору посредством ПТК ТЦ: в случае положительного результата всех указанных проверок – информация о возможности регистрации в ТС заявки, в случае отрицательного результата хотя бы одной из указанных проверок – информация о невозможности регистрации в ТС заявки.

- 13.6.1. В случае возможности регистрации в ТС заявки, Клиринговый центр начинает учитывать значение Единого лимита Участника клиринга, рассчитанное в соответствии с подпунктом 13.5.2 Правил клиринга, в качестве нового значения Единого лимита Участника клиринга.
- 13.6.2. В случае невозможности регистрации в ТС заявки, Клиринговый центр не изменяет учитываемое значение Единого лимита Участника клиринга.
- 13.7. После того, как информация о снятии зарегистрированной в ТС заявки, поданной Участником клиринга, стала доступной Клиринговому центру посредством ПТК ТЦ, Клиринговый центр рассчитывает Единый лимит Участника клиринга без учета отозванной заявки.
- 13.8. В случае регистрации в ТС заявки, являющейся в соответствии с Правилами ЕТС допустимой встречной по отношению к ранее зарегистрированной в ТС заявке, Клиринговый центр формирует в ТС подтверждения УКО по каждой из двух допустимых встречных заявок.
Курс и объем заключаемых сделок определяются в соответствии с Правилами ЕТС.
- 13.9. В целях создания условий для исполнения обязательств по Сделкам Клиринговый центр вправе по зарегистрированной в ТС заявке на продажу или заявке на покупку, в отношении которой отсутствует зарегистрированная в ТС допустимая встречная заявка, сформировать в соответствии с Правилами ЕТС в ТС подтверждение УКО, содержащее определенное Клиринговым центром значение объема заключаемой Сделки.
- 13.10. После того, как информация о регистрации в ТС Сделки стала доступной Клиринговому центру посредством ПТК ТЦ, Клиринговый центр:
- рассчитывает Единый лимит Участника клиринга без учета заявки (части заявки), на основании которой была заключена Сделка, и с учетом заключенной Сделки;
 - изменяет с учетом заключенной Сделки Нетто-обязательство и/или Нетто-требование Участника клиринга с Датами исполнения, соответствующими Дате (Датам) исполнения обязательств по заключенной Сделке.
- 13.11. Участник клиринга имеет право завершить заключение сделок с Клиринговым центром по инструментам с Датой исполнения, отличной от текущей, ранее установленного Администратором времени окончания торгов. Для реализации указанного права Участник клиринга должен предоставить Клиринговому центру Запрос на раннее завершение заключения сделок с Клиринговым центром или Постоянное поручение на раннее завершение заключения сделок с Клиринговым центром.
- 13.11.1. Запрос на раннее завершение заключения сделок с Клиринговым центром направляется в электронном виде с использованием Клиринговой системы, или на бумажном носителе по форме, предусмотренной приложением № 23 к Правилам клиринга, или в форме электронного документа.
Сроки предоставления и исполнения Запросов на раннее завершение заключения сделок с Клиринговым центром установлены Временным регламентом исполнения обязательств по сделкам, заключенным на Единой торговой сессии, являющимся

приложением № 6 к Правилам клиринга (далее – Регламент).

- 13.11.2. Постоянное поручение на раннее завершение заключения сделок с Клиринговым центром направляется в электронном виде с использованием Клиринговой системы, или на бумажном носителе по форме, предусмотренной приложением № 24 к Правилам клиринга, или в форме электронного документа.

Постоянное поручение на раннее завершение заключения сделок с Клиринговым центром исполняется Клиринговым центром каждый Расчетный день, начиная с первого Расчетного дня, следующего за датой предоставления указанного поручения.

Постоянное поручение на раннее завершение заключения сделок с Клиринговым центром действует до его отмены Участником клиринга.

Отмена Постоянного поручения на завершение заключения сделок с Клиринговым центром осуществляется с использованием Клиринговой системы или путем направления Участником клиринга Клиринговому центру документа на бумажном носителе в свободной форме.

- 13.11.3. В установленный Регламентом момент времени, Клиринговый центр направляет Администратору уведомление о раннем завершении заключения сделок с Клиринговым центром в отношении Участников клиринга, предоставивших Клиринговому центру Запрос на раннее завершение заключения сделок с Клиринговым центром или Постоянное поручение на раннее завершение заключения сделок с Клиринговым центром.

- 13.12. В случае принятия Постановления Правительства Российской Федерации о переносе выходных дней, в соответствии с которым Дата исполнения заключенных с Участниками клиринга Сделок станет выходным днем по законодательству Российской Федерации, Клиринговый центр в течение 10 (десяти) рабочих дней с даты принятия такого Постановления изменяет Даты исполнения таких заключенных Сделок на ближайший следующий Расчетный день.

При этом суммы Сделок изменяются с учетом изменения цены Сделок, рассчитанной по формуле:

$RateN = RateO + Rate_delta$, где

RateN – цена Сделки после изменения Даты исполнения,

RateO – цена Сделки до изменения Даты исполнения,

Rate_delta - корректировка цены сделки,

$Rate_delta = SWAPCRate_dN - SWAPCRate_dO$, где

Rate_delta – корректировка цены сделки,

SWAPCRate_dN – центральное значение Индикативного курса сделок своп на новую Дату исполнения Сделки (после изменения),

SWAPCRate_dO – центральное значение Индикативного курса сделок своп на первоначальную Дату исполнения Сделки (до изменения).

После изменения Даты исполнения Сделок в соответствии с настоящим пунктом Правил клиринга, Клиринговый центр изменяет Нетто-обязательства / Нетто-требования Участников клиринга по соответствующим Датам исполнения в соответствии с измененными условиями Сделок.

Суммы рассчитанных комиссионных вознаграждений по Сделкам, Дата исполнения которых изменена, не меняются.

После изменения Дат исполнения и сумм Сделок Клиринговый центр формирует и передает Участникам клиринга Отчеты о сделках, Дата исполнения которых перенесена, по форме, приведенной в приложении № 41 к Правилам клиринга.

Об изменении Дат исполнения и сумм Сделок Клиринговый центр уведомляет Администратора посредством ПТК ТЦ.

14. Порядок проведения клиринговых сессий

14.1. До начала торгов в установленное Регламентом время Клиринговый центр проводит клиринговую сессию, в ходе которой Клиринговый центр:

- устанавливает в качестве Центральных курсов Центральные курсы, определенные в предыдущий Рабочий день;
- устанавливает риск-параметры в соответствии с Методикой определения риск-параметров валютного рынка;
- для каждого Участника клиринга рассчитывает и устанавливает новые значения Единых лимитов и Торговых лимитов Участника клиринга;
- определяет обязательства Участников клиринга и Клирингового центра по уплате Компенсационных взносов;
- формирует и передает каждому Участнику клиринга, имеющему обязательства по Сделкам, Дата исполнения которых не наступила, Отчет об обязательствах, реквизиты которого предусмотрены приложением № 27 к Правилам клиринга;
- формирует и передает Участникам клиринга, у которых возникли Задолженности, Отчет «Требование о погашении Задолженности». Реквизиты Отчета «Требование о погашении Задолженности» предусмотрены приложением № 16 к Правилам клиринга;
- определяет Участников клиринга, у которых возникли Маржинальные требования и суммы указанных Маржинальных требований: Маржинальное требование возникает у Участника клиринга, Единый лимит которого стал отрицательным; сумма Маржинального требования равна абсолютному значению текущего Единого лимита Участника клиринга;
- формирует и передает Участникам клиринга, у которых возникли Маржинальные требования, Отчет о Маржинальном требовании, содержащий информацию о его сумме. Реквизиты Отчета о Маржинальном требовании предусмотрены приложением № 10 к Правилам клиринга.

14.2. Размер обязательства Участника клиринга и Клирингового центра по уплате Компенсационного взноса рассчитывается по обязательствам по Сделкам, Дата исполнения которых не наступила, по формуле:

$$\text{COM_RUB} = \sum_i (\sum_j \text{OBL_VAL}_{ij} \times (\text{Rc_RUB_VAL}_j + \text{SWAPCRate_VAL}_{ij}) + \text{OBL_RUB}_i) + \text{RET_RUB}, \text{ где}$$

COM_RUB – размер обязательства по уплате Компенсационного взноса, рассчитанный в ходе текущей клиринговой сессии;

OBL_VAL_{ij} – сумма (с учетом знака) Нетто-обязательств / Нетто-требований в иностранной валюте VAL_j с i-ой Датой исполнения;

OBL_RUB_i - Нетто-обязательство / Нетто-требование Участника клиринга (с учетом знака) в российских рублях с i-ой Датой исполнения;

$Rc_RUB_VAL_j$ – Центральный курс Сделок по покупке и продаже иностранной валюты VAL_j за российские рубли, рассчитанный в предыдущий Рабочий день;

$SWAPCRate_VAL_{ij}$ - центральное значение Индикативного курса сделок своп, установленного в предыдущий Рабочий день для i -ой Даты исполнения и иностранной валюты VAL_j за российские рубли. Для Даты исполнения в Расчетный день, следующий за текущим, значение $SWAPCRate_VAL_i$ равно нулю;

VAL_j – иностранная валюта, являющейся валютой лота для Сделок с частичным обеспечением;

RET_RUB – размер непрекращенного обязательства по возврату Компенсационных взносов (с учетом знака), рассчитанный в предыдущий Рабочий день;

$\sum_i$ – сумма по Датам исполнения;

$\sum_j$ - сумма по валютам VAL .

Если значение COM_RUB отрицательное, это означает наличие обязанности Участника клиринга по уплате Компенсационного взноса Клиринговому центру в размере, равном абсолютному значению COM_RUB , если положительное – наличие требования Участника клиринга к Клиринговому центру по получению Компенсационного взноса в размере, равном значению COM_RUB .

Информация о размере обязательства Участника клиринга по уплате Компенсационного взноса указывается в Отчете об обязательствах.

- 14.3. Размер обязательства Участника клиринга и Клирингового центра по возврату Компенсационных взносов рассчитывается по формуле:

$RET_RUB_{new} = RET_RUB - COM_RUB$, где

RET_RUB_{new} – размер обязательства по возврату Компенсационных взносов (с учетом знака);

RET_RUB – размер непрекращенного обязательства по возврату Компенсационных взносов (с учетом знака), рассчитанный в предыдущий Рабочий день;

COM_RUB – размер обязательства (с учетом знака) по уплате Компенсационного взноса, рассчитанный в ходе текущей клиринговой сессии.

Если значение RET_RUB_{new} отрицательное, это означает наличие обязанности Участника клиринга по возврату Клиринговому центру Компенсационных взносов в размере, равном абсолютному значению RET_RUB_{new} , если положительное – наличие обязанности Клирингового центра по возврату Участнику клиринга Компенсационных взносов в размере, равном значению RET_RUB_{new} .

- 14.4. Если размер обязательства Участника клиринга по уплате Компенсационных взносов, определенный в ходе клиринговой сессии, отрицательный, на его абсолютное значение уменьшается размер Обеспечения Участника клиринга в российских рублях, если положительный, на его значение увеличивается размер Обеспечения Участника клиринга в российских рублях.

- 14.5. Если Обеспечения Участника клиринга в российских рублях, недостаточно для исполнения обязательства Участника клиринга по уплате Компенсационных взносов в полном объеме, неисполненное обязательство (неисполненная часть обязательства)

Участника клиринга по уплате Компенсационных взносов учитывается Клиринговым центром как Задолженность по компенсационным взносам Участника клиринга перед Клиринговым центром.

Указанная Задолженность по компенсационным взносам должна быть погашена Участником клиринга до установленного Регламентом времени текущего Рабочего дня.

Информация о наличии Задолженности по компенсационным взносам и ее размере передается Участнику клиринга в составе отчета «Требование о погашении Задолженности».

Отчет «Требование о погашении Задолженности» направляется Участнику клиринга в форме электронного документа в срок, установленный Регламентом.

14.6. Порядок действий Клирингового центра при неисполнении Участником клиринга Задолженности по компенсационным взносам в срок, установленный в пункте 14.5 Правил клиринга, определен в разделе 19 Правил клиринга.

14.7. Проценты на сумму уплаченных и/или полученных Компенсационных взносов не начисляются и не уплачиваются.

14.8. Маржинальное требование, возникшее у Участника клиринга по итогам клиринговой сессии, должно быть исполнено Участником клиринга не позднее установленного Регламентом времени текущего Рабочего дня.

14.9. Маржинальное требование должно быть исполнено Участником клиринга путем перечисления денежных средств в валютах, являющихся валютой лота или сопряженной валютой для Сделок с частичным обеспечением, на счета Клирингового центра в порядке, определенном разделом 15 Правил клиринга.

Маржинальное требование может быть также прекращено полностью или в части в случаях:

- исполнения обязательств по Сделкам с наступившей Датой исполнения;
- заключения Сделок, приводящих к увеличению Единого лимита Участника клиринга;
- увеличения Лимита, обеспеченного средствами фонда, в результате перераспределения Участником клиринга Лимита, обеспеченного средствами фонда, между его Регистрационными и Расчетными кодами, в соответствии с подпунктами 12.5.2-12.5.4 Правил клиринга.

14.10. Маржинальное требование по Расчетному коду, возникшее у Участника клиринга, считается прекращенным в момент времени, когда Единый лимит Участника клиринга по такому Расчетному коду станет неотрицательным.

14.11. Порядок действий Клирингового центра при ненадлежащем исполнении Участником клиринга Маржинального требования определен в разделе 18 Правил клиринга.

15. Порядок внесения и возврата Обеспечения

15.1. Настоящий раздел Правил клиринга устанавливает порядок перечисления Участниками клиринга на счета Клирингового центра денежных средств, являющихся

Обеспечением, а также порядок возврата денежных средств, являющихся Обеспечением, Участникам клиринга.

- 15.2. Участник клиринга обязан перечислять денежные средства в соответствующей валюте, которые предоставляются им в качестве Обеспечения, на счет Клирингового центра в соответствующей валюте, открытый в Расчетном центре / Расчетном банке, с обязательным указанием в назначении платежа соответствующего Расчетного кода Участника клиринга.
- 15.3. Клиринговый центр обязан учесть в Клиринговой системе денежные средства, перечисленные Участником клиринга, в качестве Обеспечения Участника клиринга не позднее срока, установленного Регламентом, и увеличить Единый лимит Участника клиринга с учетом перечисленной суммы денежных средств.
- 15.4. Денежные средства, учитываемые в качестве Обеспечения Участника клиринга, используются для расчета Единого лимита, обеспечения исполнения обязательств по Сделкам, исполнения Итоговых нетто-обязательств в иностранной валюте, Итоговых обязательств в российских рублях и обязательств по уплате комиссионных вознаграждений по Расчетному коду, по которому указанное Обеспечение учитывается.
- 15.5. Участник клиринга может перевести денежные средства, учитываемые в качестве Обеспечения, между своими Расчетными кодами, подав в Клиринговый центр Заявление о переводе денежных средств в электронном виде с использованием Клиринговой системы, или на бумажном носителе по форме, установленной приложением № 31 к Правилам клиринга, или в форме электронного документа.
- Данное заявление не принимается Клиринговым центром к исполнению, если сумма денежных средств в определенной валюте, указанная Участником клиринга в заявлении, превышает сумму денежных средств, учитываемых в качестве Обеспечения Участника клиринга по Расчетному коду, с которого денежные средства должны быть списаны, или если Единый лимит Участника клиринга по Расчетному коду, с которого денежные средства, учитываемые в качестве Обеспечения Участника клиринга, должны быть списаны, в результате такого списания станет отрицательным, или отрицательный Единый лимит Участника клиринга по такому Расчетному коду в результате такого списания уменьшится.
- При исполнении Заявления о переводе денежных средств, сумма денежных средств Участника клиринга в соответствующей валюте, учитываемых в качестве Обеспечения Участника клиринга по Расчетному коду, с которого списываются денежные средства, уменьшается, а по Расчетному коду, на который зачисляются денежные средства, - увеличивается на сумму переводимых денежных средств.
- 15.6. Обеспечение Участника клиринга в российских рублях используется в следующей очередности:
- 1) для уплаты пеней за наличие на момент начала Дополнительной сессии ЕТС первого типа непогашенной Задолженности по сделкам и/или Задолженности по комиссиям и/или Задолженности по компенсационным взносам;
 - 2) для погашения Задолженности по комиссиям Участника клиринга перед Клиринговым центром;
 - 3) для погашения Задолженности по Компенсационным взносам Участника

- клиринга перед Клиринговым центром;
- 4) для погашения Задолженности по сделкам Участника клиринга перед Клиринговым центром;
 - 5) для обеспечения исполнения обязательств Участника клиринга по Сделкам с полным обеспечением и Сделкам с частичным обеспечением;
 - 6) для исполнения обязательств Участника клиринга в российских рублях по Сделкам с полным обеспечением и Сделкам с частичным обеспечением с наступившей Датой исполнения;
 - 7) для исполнения обязательства Участника клиринга по возврату Компенсационных взносов;
 - 8) для исполнения обязательств Участника клиринга по уплате комиссионного вознаграждения в пользу Клирингового центра;
 - 9) для исполнения обязательств Участника клиринга по уплате комиссионного вознаграждения в пользу Администратора.
- 15.7. Обеспечение Участника клиринга в иностранной валюте, являющейся валютой лота или сопряженной валютой для Сделок с частичным обеспечением используется в следующей очередности:
- 1) для обеспечения исполнения обязательств Участника клиринга по Сделкам с частичным обеспечением;
 - 2) для исполнения обязательств Участника клиринга в соответствующей иностранной валюте по Сделкам с частичным обеспечением с наступившей Датой исполнения.
- 15.8. Обеспечение Участника клиринга в иностранной валюте, являющейся валютой лота для Сделок с полным обеспечением, используется:
- 1) для обеспечения исполнения обязательств Участника клиринга в валюте лота по Сделкам с полным обеспечением;
 - 2) для исполнения обязательств Участника клиринга в валюте лота по Сделкам с полным обеспечением с наступившей Датой исполнения.
- 15.9. После перечисления Участником клиринга денежных средств на счет Клирингового центра, открытый в Расчетном банке или Расчетном центре, и учета их в качестве Обеспечения Участника клиринга, у Клирингового центра возникает обязательство вернуть денежные средства Участнику клиринга в размере, определяемом в соответствии с пунктами 15.12, 15.13 Правил клиринга.
- 15.10. Возврат Клиринговым центром Участнику клиринга денежных средств, учитываемых в качестве Обеспечения Участника клиринга, осуществляется на основании Запроса о возврате денежных средств либо Постоянного поручения на возврат денежных средств в следующем порядке.
- 15.10.1. Запрос о возврате денежных средств направляется Участником клиринга в электронном виде с использованием Клиринговой системы, или на бумажном носителе по форме, предусмотренной приложением № 11 к Правилам клиринга, или в форме электронного документа. В случае если между Участником клиринга и Клиринговым центром предусмотрен обмен сообщениями по системе S.W.I.F.T., Участник клиринга вправе направить Запрос о возврате денежных средств в форме

сообщения по системе S.W.I.F.T.

Сроки предоставления Запросов о возврате денежных средств установлены Регламентом.

При предоставлении Запроса о возврате денежных средств позднее времени, указанного в Регламенте, Запрос о возврате денежных средств не исполняется.

Запрос о возврате денежных средств действует в день его предоставления.

Запрос о возврате денежных средств, полученный в сроки, установленные Регламентом, исполняется после его получения при соблюдении условия, указанного в пункте 15.12 Правил клиринга.

- 15.10.2. Постоянное поручение на возврат денежных средств направляется Участником клиринга в электронном виде с использованием Клиринговой системы или на бумажном носителе по форме, предусмотренной приложением № 12 к Правилам клиринга, или в форме электронного документа.

Постоянное поручение на возврат денежных средств исполняется Клиринговым центром каждый Расчетный день, начиная с первого Расчетного дня, следующего за датой предоставления указанного поручения, после исполнения Участником клиринга Итоговых нетто-обязательств в иностранной валюте / Итоговых обязательств в российских рублях и обязательств по уплате комиссионных вознаграждений в сумме, определенной в соответствии с пунктом 15.13 Правил клиринга.

Постоянное поручение на возврат денежных средств действует до его отмены Участником клиринга.

Отмена Постоянного поручения на возврат денежных средств осуществляется с использованием Клиринговой системы или путем направления Участником клиринга Клиринговому центру документа на бумажном носителе в свободной форме или электронного документа.

- 15.11. При непредоставлении Участником клиринга Запроса о возврате денежных средств или Постоянного поручения на возврат денежных средств Обеспечение Участника клиринга будет учтено Клиринговым центром для его использования в торгах следующего торгового дня.
- 15.12. Возврат Клиринговым центром Участнику клиринга денежных средств в соответствии с Запросом о возврате денежных средств осуществляется только в том случае, если Единый лимит Участника клиринга, рассчитанный без учета возвращаемой суммы денежных средств, не станет отрицательным.
- 15.13. Возврат Клиринговым центром Участнику клиринга денежных средств в соответствии с Постоянным поручением на возврат денежных средств осуществляется в сумме, без учета которой Единый лимит Участника клиринга не станет отрицательным.
- 15.14. Для исполнения своего обязательства по возврату Участнику клиринга денежных средств в соответствующей валюте Клиринговый центр перечисляет денежные средства в данной валюте на Счет в соответствующей валюте для возврата денежных средств, зарегистрированный в Клиринговом центре для соответствующего Расчетного кода Участника клиринга.
- 15.15. Обязательство Клирингового центра по возврату денежных средств Участнику клиринга считается исполненным с момента списания Расчетным центром или

Расчетным банком денежных средств с соответствующего счета Клирингового центра.

- 15.16. При возврате Участнику клиринга денежных средств в соответствующей валюте размер Обеспечения Участника клиринга в этой валюте уменьшается на сумму возвращаемых денежных средств.
- 15.17. Клиринговый центр вправе осуществить в любое время зачет денежных требований Участника клиринга по возврату ему денежных средств с денежными требованиями Клирингового центра к этому Участнику клиринга.
- 15.18. Информация об операциях с Обеспечением Участника клиринга передается Участнику клиринга в составе Отчета о движении денежных средств, реквизиты которого предусмотрены приложением № 38 к Правилам клиринга.
Отчет о движении денежных средств, содержащий информацию об операциях с Обеспечением, выполненных в течение предыдущего Рабочего дня, направляется Участнику клиринга в форме электронного документа в срок, установленный Регламентом.
- 15.19. Клиринговый центр осуществляет ежегодную сверку остатков Обеспечения Участника клиринга в соответствующих валютах путем направления соответствующего уведомления Участнику клиринга не позднее десятого рабочего дня года, следующего за отчетным годом.
Если в течение десяти рабочих дней после направления Участнику клиринга указанного уведомления, Участник клиринга не уведомит Клиринговый центр о наличии расхождений, остатки Обеспечения Участника клиринга в соответствующих валютах считаются подтвержденными.

16. Порядок внесения и возврата вноса в Фонд

- 16.1. Для учета денежных средств в качестве вноса в Фонд Участник клиринга обязан перечислить денежные средства в долларах США в сумме, не меньшей установленного Клиринговым центром размера вноса в Фонд, на счет Клирингового центра, открытый в соответствующем Расчетном банке, с обязательным указанием в назначении платежа слова «FUNDS» и после него без пробелов Расчетного кода Участника клиринга.

Пример назначения платежа: «TRANSFER OF FUNDSXXXXX», где XXXXX – Расчетный код.

В случае внесения в Фонд денежных средств в сумме, превышающей установленный Клиринговым центром размер вноса в Фонд, в качестве вноса в Фонд данного Участника клиринга учитываются денежные средства в сумме, равной установленному Клиринговым центром размеру вноса в Фонд.

Денежные средства Участника клиринга, перечисленные на счет Клирингового центра, предназначенный для учета средств Фонда, в сумме, превышающей установленный Клиринговым центром размер вноса в Фонд, возвращаются Клиринговым центром Участнику клиринга по письменному требованию Участника клиринга.

- 16.2. После перечисления Участником клиринга денежных средств на счет Клирингового центра, открытый в Расчетном банке, и учета их в качестве вноса Участника клиринга в Фонд, у Клирингового центра возникает обязательство вернуть Участнику клиринга денежные средства в размере вноса Участника клиринга в Фонд.
- 16.3. Возврат Участнику клиринга его вноса в Фонд осуществляется при прекращении допуска к клиринговому обслуживанию в соответствии с пунктом 7.8 Правил клиринга.
- 16.4. Участник клиринга вправе предоставить Клиринговому центру Заявление о возврате вноса в Фонд по форме, предусмотренной приложением № 36 к Правилам клиринга. Заявление Участника клиринга о возврате вноса в Фонд исполняется Клиринговым центром в случае отсутствия у Участника клиринга Задолженности и/или неисполненных обязательств по Сделкам не позднее Расчетного дня, следующего за датой получения указанного заявления.
- Для исполнения Заявления Участника клиринга о возврате вноса в Фонд, Клиринговый центр устанавливает Участнику клиринга Лимит, обеспеченный средствами фонда, равным нулю и прекращает его участие в Фонде, после чего перечисляет денежные средства, составляющие взнос Участника клиринга в Фонд, учитываемый на дату возврата, по реквизитам, указанным в таком заявлении.
- 17. Порядок исполнения / прекращения обязательств по Сделкам и обязательств по возврату Компенсационных взносов**
- 17.1. В сроки, установленные Регламентом, Клиринговый центр определяет Итоговые нетто-обязательства / Итоговые нетто-требования Участников клиринга в иностранной валюте и/или Итоговые обязательства / Итоговые требования Участников клиринга в российских рублях.
- 17.1.1. В случае если для какой-либо иностранной валюты, включенной в Перечень инструментов, по которым заключаются Сделки с частичным обеспечением, время окончания торгов, на которых заключаются сделки с исполнением обязательств в дату их заключения, раньше, чем время окончания всех торгов, на которых заключаются сделки с исполнением обязательств в дату их заключения, то по окончании торговой сессии по такой иностранной валюте и получения от Администратора выписки из реестра сделок по итогам указанной торговой сессии Клиринговый центр:
- зачитывает встречные однородные обязательства и требования Участника клиринга и Клирингового центра в такой иностранной валюте по Сделкам с наступившей Датой исполнения, а в части, в которой обязательства и требования не были зачтены – определяет Итоговое нетто-обязательство и/или Итоговое нетто-требование каждого Участника клиринга в такой иностранной валюте;
 - формирует и передает Участникам клиринга предварительные Биржевые свидетельства (по форме, приведенной в приложении № 39 к Правилам клиринга).
- 17.1.2. Порядок исполнения / прекращения Итогового нетто-обязательства или Итогового нетто-требования, определенного в соответствии с настоящим пунктом Правил клиринга, определен настоящим разделом Правил клиринга, сроки исполнения – Регламентом.

Необходимым условием исполнения Клиринговым центром Итогового нетто-требования Участника клиринга в иностранной валюте, определенного в соответствии с настоящим пунктом Правил клиринга, является наличие у Участника клиринга достаточного Обеспечения.

17.2. По окончании всех торгов, на которых заключаются сделки с исполнением обязательств в дату их заключения, и получения от Администратора выписки из реестра сделок по итогам Торговых сессий ЕТС Клиринговый центр:

17.2.1. зачитывает встречные однородные обязательства и требования Участника клиринга и Клирингового центра по Сделкам с наступившей Датой исполнения в каждой валюте, а в части, в которой обязательства и требования не были зачтены – определяет Итоговые нетто-обязательства и/или Итоговые нетто-требования каждого Участника клиринга в каждой валюте;

17.2.2. рассчитывает обязательство каждого Участника клиринга и Клирингового центра по возврату Компенсационных взносов по Сделкам с наступившей Датой исполнения по формуле:

$RET_RUB = -(\sum_j OBL_VAL_j \times Rc_RUB_VAL_j + OBL_RUB)$, где

RET_RUB – размер обязательства Участника клиринга и Клирингового центра по возврату Компенсационных взносов (в российских рублях);

OBL_VAL_j – Итоговое нетто-обязательство / Итоговое нетто-требование Участника клиринга (с учетом знака) в иностранной валюте VAL_j, рассчитанное без учета Сделок, обязательства по уплате Компенсационных взносов по которым в соответствии с Правилами клиринга не возникают;

OBL_RUB – Итоговое нетто-обязательство / Итоговое нетто-требование Участника клиринга (с учетом знака) в российских рублях, рассчитанное без учета Сделок, обязательства по уплате Компенсационных взносов по которым в соответствии с Правилами клиринга не возникают;

Rc_RUB_VAL_j – Центральный курс Сделок по покупке и продаже иностранной валюты VAL_j за российские рубли, рассчитанный в день T-2, где T – текущий Рабочий день;

VAL_j – иностранная валюта, являющаяся валютой лота для Сделок с частичным обеспечением;

$\sum_j$ - сумма по валютам VAL.

Если значение RET_RUB отрицательное, это означает наличие обязанности Участника клиринга по возврату Клиринговому центру Компенсационных взносов в размере, равном абсолютному значению RET_RUB, если положительное – наличие обязанности Клирингового центра по возврату Участнику клиринга Компенсационных взносов в размере, равном значению RET_RUB.

17.2.3. зачитывает встречные однородные обязательства и требования Участника клиринга и Клирингового центра в российских рублях, указанные в подпунктах 17.2.1-17.2.2 Правил клиринга, а в части, в которой указанные обязательства и требования не были зачтены – определяет Итоговое обязательство / Итоговое требование Участника клиринга в российских рублях.

17.3. Процедуры, указанные в пункте 17.2 Правил клиринга, могут быть выполнены Клиринговым центром в отношении отдельных Участников клиринга до окончания

торгов, на которых заключаются сделки с исполнением обязательств в дату их заключения, в случае получения от Участника клиринга Запроса на проведение ранних расчетов или Постоянного поручения на проведение ранних расчетов.

- 17.3.1. Запрос на проведение ранних расчетов направляется в электронном виде с использованием Клиринговой системы, или на бумажном носителе по форме, предусмотренной приложением № 13 к Правилам клиринга, или в форме электронного документа.

Сроки предоставления и исполнения Запросов на проведение ранних расчетов установлены Регламентом.

- 17.3.2. Постоянное поручение на проведение ранних расчетов направляется в электронном виде с использованием Клиринговой системы, или на бумажном носителе по форме, предусмотренной приложением № 14 к Правилам клиринга, или в форме электронного документа.

Постоянное поручение на проведение ранних расчетов исполняется Клиринговым центром каждый Расчетный день, начиная с первого Расчетного дня, следующего за датой предоставления указанного поручения.

Постоянное поручение на проведение ранних расчетов действует до его отмены Участником клиринга.

Отмена Постоянного поручения на проведение ранних расчетов осуществляется с использованием Клиринговой системы или путем направления Участником клиринга Клиринговому центру документа на бумажном носителе в свободной форме.

- 17.3.3. После получения от Участника клиринга Запроса на проведение ранних расчетов или в установленный Регламентом момент времени, Клиринговый центр направляет Администратору уведомление о проведении ранних расчетов в отношении Участника клиринга, предоставившего Клиринговому центру Запрос на проведение ранних расчетов или Постоянное поручение на проведение ранних расчетов соответственно.

- 17.4. После определения обязательств Участников клиринга, указанных в пункте 17.1 Правил клиринга, Клиринговый центр формирует и передает Участникам клиринга Клиринговые отчеты по итогам Торговых сессий ЕТС и Биржевые свидетельства по итогам Торговых сессий ЕТС.

Форма Клирингового отчета по итогам Торговых сессий ЕТС приведена в приложении № 25 к Правилам клиринга.

Форма Биржевого свидетельства по итогам Торговых сессий ЕТС приведена в приложении № 7 к Правилам клиринга.

- 17.5. Участник клиринга вправе до установленного Регламентом времени предоставить Клиринговому центру Заявление о переносе, которое является уведомлением об изменении по инициативе Участника клиринга Даты исполнения обязательств по всем Сделкам с частичным обеспечением с наступившей Датой исполнения, заключенным с указанием определенного Расчетного кода и/или за счет определенного Клиента, на дату, соответствующую следующему Расчетному дню.

- 17.5.1. Заявление о переносе направляется Участником клиринга на бумажном носителе по форме, предусмотренной приложением № 37 к Правилам клиринга, или в форме электронного документа.

Заявление о переносе действует в день его предоставления.

При предоставлении Заявления о переносе позднее установленного Регламентом времени, Заявление о переносе не исполняется.

- 17.5.2. В Заявлении о переносе обязательно должен быть указан Расчетный код, по которому учитываются обязательства по Сделкам с частичным обеспечением, Дата исполнения которых изменяется, а также может быть указать код Клиента, за счет которого заключены указанные сделки.

Если код Клиента в Заявлении о переносе не указан, то изменению подлежит Дата исполнения всех Сделок с частичным обеспечением с наступившей Датой исполнения, обязательства по которым учитываются по указанному в Заявлении о переносе Расчетному коду.

- 17.5.3. Заявление о переносе не исполняется Клиринговым центром, если:

- допуск к клиринговому обслуживанию Участника клиринга со следующего Расчетного дня приостановлен или прекращен;
- по Расчетному коду Участника клиринга, указанному в Заявлении о переносе, в текущую дату было проведено частичное или полное исполнение обязательств по Сделкам с частичным обеспечением с наступившей Датой исполнения;
- количество исполненных Заявлений о переносе хотя бы для одной из Сделок, Дата исполнения которой должна быть изменена на основании такого заявления, равно 5 (пяти).

- 17.5.4. Для исполнения Заявления о переносе Клиринговый центр исключает обязательства по Сделкам с частичным обеспечением с наступившей Датой исполнения, обязательства по которым учитываются по указанному в Заявлении о переносе Расчетному коду, или Сделки, заключенные Участником клиринга за счет Клиента, указанного в Заявлении о переносе, из расчета Итоговых нетто-обязательств / Итоговых нетто-требований Участника клиринга в соответствующей валюте и включает в расчет Нетто-обязательств / Нетто-требований в соответствующей валюте с Датой исполнения в Расчетный день, следующий за текущим.

- 17.5.5. За исполнение Заявления о переносе Участник клиринга обязан уплатить Клиринговому центру комиссионное вознаграждение, рассчитываемое по формуле:

$Fee = 1,18 \times (D \times 2 \times S \times n / 365)$, где

Fee – сумма комиссионного вознаграждения, в российских рублях,

D – нетто-обязательство по Сделкам, Дата исполнения которых изменена, в российских рублях,

S – ставка, установленная Клиринговым центром в соответствии с Методикой определения риск-параметров валютного рынка для валюты нетто-обязательства по Сделкам, Дата исполнения которых изменена,

n – количество календарных дней между датой расчета суммы комиссионного вознаграждения и следующим Рабочим днем.

Нетто-обязательство в иностранной валюте по Сделкам, Дата исполнения которых изменена, для целей расчета суммы комиссионного вознаграждения в соответствии с настоящим подпунктом Правил клиринга, пересчитывается в российские рубли по курсу, установленному Банком России на дату расчета суммы комиссионного вознаграждения.

Сумма комиссионного вознаграждения, рассчитанная в соответствии с настоящим подпунктом Правил клиринга, включает в себя НДС.

Порядок взимания комиссионного вознаграждения, рассчитанного в соответствии с настоящим подпунктом Правил клиринга, определен в разделе 18 Правил клиринга.

- 17.5.6. После исполнения Заявления о переносе Клиринговый центр формирует и передает Участнику клиринга новый Клиринговый отчет по итогам Торговых сессий ЕТС, новое Биржевое свидетельство по итогам Торговых сессий ЕТС, а также Отчет о сделках, Дата исполнения которых перенесена, по форме, приведенной в приложении № 41 к Правилам клиринга.

Биржевое свидетельство по итогам Торговых сессий ЕТС и Клиринговый отчет по итогам Торговых сессий ЕТС, направленные Участнику клиринга ранее, утрачивают силу с момента направления ему Клиринговым центром Биржевого свидетельства по итогам Торговых сессий ЕТС и Дополнительной сессии ЕТС в соответствии с настоящим подпунктом Правил клиринга.

- 17.6. Необходимым условием исполнения Клиринговым центром Итоговых нетто-требований Участника клиринга в соответствующей валюте и Итогового требования Участника клиринга в российских рублях является исполнение Участником клиринга своих Итоговых нетто-обязательств в иностранной валюте и/или Итогового обязательства Участника клиринга в российских рублях перед Клиринговым центром, за исключением случая, предусмотренного пунктом 17.14 Правил клиринга.

- 17.7. Участник клиринга обязан исполнить свои Итоговые нетто-обязательства в иностранной валюте и/или Итоговое обязательство в российских рублях до времени, указанного в Регламенте.

В случае исполнения Участником клиринга Итоговых нетто-обязательств в иностранной валюте и/или Итогового обязательства в российских рублях в полном объеме в указанный срок данный Участник клиринга признается Добросовестным участником клиринга.

В случае неисполнения Участником клиринга Итоговых нетто-обязательств в иностранной валюте и/или Итогового обязательства в российских рублях в полном объеме и/или в указанный срок данный Участник клиринга признается Недобросовестным участником клиринга.

- 17.8. Порядок действий Клирингового центра при неисполнении или ненадлежащем исполнении Участником клиринга своих Итоговых нетто-обязательств в иностранной валюте и/или Итогового обязательства в российских рублях определен в разделе 19 Правил клиринга.

- 17.9. Для исполнения Итоговых нетто-обязательств Участника клиринга в иностранной валюте и/или Итогового обязательства Участника клиринга в российских рублях используется Обеспечение Участника клиринга в соответствующей валюте, в порядке, определенном пунктами 15.6-15.8 Правил клиринга.

Сроки перечисления денежных средств на счета Клирингового центра для учета в качестве Обеспечения текущим днем определены Регламентом.

Датой и временем перечисления Участниками клиринга денежных средств на счета Клирингового центра являются дата и время зачисления денежных средств на соответствующие счета Клирингового центра, открытые в Расчетных банках и Расчетных центрах.

Перечисление денежных средств позже установленного срока с зачислением их ранее

даты перевода (back value) не разрешается.

- 17.10. Клиринговый центр зачитывает Итоговое нетто-обязательство Участника клиринга в иностранной валюте и/или Итоговое обязательство Участника клиринга в российских рублях с требованием Участника клиринга по возврату денежных средств в соответствующей валюте, учитываемых в качестве Обеспечения Участника клиринга. Итоговое нетто-обязательство Участника клиринга в иностранной валюте и/или Итоговое обязательство Участника клиринга в российских рублях считается исполненным, если размер Обеспечения Участника клиринга в соответствующей валюте не меньше, чем Итоговое нетто-обязательство Участника клиринга в иностранной валюте и/или Итоговое обязательство Участника клиринга в российских рублях. При этом размер Обеспечения Участника клиринга в соответствующей валюте уменьшается на сумму исполненного Итогового нетто-обязательства / Итогового обязательства.
- 17.11. Итоговое нетто-требование Участника клиринга в иностранной валюте и/или Итоговое требование Участника клиринга в российских рублях прекращается возникновением обязательства Клирингового центра по возврату Участнику клиринга денежных средств в соответствующей валюте, учитываемых в качестве Обеспечения Участника клиринга, в размере Итогового нетто-требования в иностранной валюте и/или Итогового требования в российских рублях. При этом размер Обеспечения Участника клиринга в соответствующей валюте увеличивается на сумму прекращенного Итогового нетто-требования / Итогового требования Участника клиринга в этой валюте.
- 17.11.1. После этого обязательство Клирингового центра по возврату Участнику клиринга денежных средств в соответствующей валюте, учитываемых в качестве Обеспечения Участника клиринга, зачитывается с обязательством Участника клиринга по погашению его Задолженности по комиссиям, Задолженности по компенсационным взносам и Задолженности по сделкам перед Клиринговым центром в этой валюте (в случае наличия у Участника клиринга такого обязательства). При этом размер Обеспечения Участника клиринга в российских рублях уменьшается на сумму Задолженности по комиссиям Участника клиринга, сумму Задолженности по компенсационным взносам Участника клиринга, а затем - на сумму Задолженности по сделкам Участника клиринга.
- 17.11.2. После этого Клиринговый центр осуществляет возврат Участникам клиринга денежных средств, учитываемых в качестве Обеспечения Участника клиринга, в сумме Итогового нетто-требования в соответствующей валюте, но не более чем сумма денежных средств Участника клиринга в данной валюте, учитываемых в качестве Обеспечения Участника клиринга, при условии, что возврат этой суммы не приведет к возникновению у Участника клиринга отрицательного Единого лимита, либо в максимально возможной сумме, не превышающей сумму денежных средств Участника клиринга в данной валюте, учитываемых в качестве Обеспечения Участника клиринга, возврат которой не приведет к возникновению у Участника клиринга отрицательного Единого лимита.
- 17.11.3. В случае предоставления Участником клиринга Клиринговому центру Запроса о депонировании денежных средств, сумма денежных средств в соответствующей

валюте, подлежащая возврату Клиринговым центром Участнику клиринга в соответствии с подпунктом 17.11.2 Правил клиринга, уменьшается на сумму денежных средств в этой валюте, указанную Участником клиринга в Запросе о депонировании денежных средств.

Запрос о депонировании денежных средств направляется в электронном виде с использованием Клиринговой системы, или на бумажном носителе по форме, предусмотренной приложением № 15 к Правилам клиринга, или в форме электронного документа.

Сроки предоставления Запросов о депонировании денежных средств установлены Регламентом.

При предоставлении Запроса о депонировании денежных средств позднее времени, указанного в Регламенте, Запрос о депонировании денежных средств не исполняется.

Запрос о депонировании денежных средств действует в день его предоставления.

17.12. Возврат Клиринговым центром Участнику клиринга денежных средств в соответствующей валюте в соответствии с пунктом 17.11 Правил клиринга осуществляется путем перечисления денежных средств в данной валюте на зарегистрированный Участником клиринга в Клиринговом центре Счет в соответствующей валюте для возврата денежных средств.

17.13. При возврате Участнику клиринга денежных средств в соответствующей валюте, учитываемых в качестве Обеспечения Участника клиринга, размер Обеспечения Участника клиринга в этой валюте уменьшается на сумму возвращаемых денежных средств.

17.14. При частичном своевременном исполнении Участником клиринга своих Итоговых нетто-обязательств в иностранной валюте и/или Итогового обязательства в российских рублях Клиринговый центр частично исполняет Итоговые нетто-требования Участника клиринга в иностранной валюте и/или Итоговое требование Участника клиринга в российских рублях в порядке, определенном пунктом 17.11 Правил клиринга, в сумме, определяемой Клиринговым центром, и имеет право вернуть Участнику клиринга денежные средства в указанной сумме в порядке, определенном пунктом 17.12 Правил клиринга.

Клиринговый центр вправе не возвращать денежные средства Участнику клиринга, частично исполнившему свои Итоговые нетто-обязательства в иностранной валюте и/или Итоговое обязательство в российских рублях, до полного исполнения Участником клиринга своих Итоговых нетто-обязательств в иностранной валюте и Итогового обязательства в российских рублях.

Если Участник клиринга имеет требования к Клиринговому центру по возврату денежных средств в разных валютах, то их исполнение в соответствии с настоящим пунктом Правил клиринга осуществляется в следующем порядке: сначала возвращаются денежные средства в той валюте, Итоговые нетто-обязательства Участника клиринга в которой имеют более ранний срок исполнения в течение одного Расчетного дня, установленный Регламентом.

17.15. В случае предоставления Участником клиринга Клиринговому центру Постоянного поручения на депонирование денежных средств, денежные средства в соответствующей валюте Клиринговым центром Участнику клиринга в соответствии

с пунктом 17.11 Правил клиринга не возвращаются. В этом случае возврат Участнику клиринга денежных средств осуществляется только на основании Запроса о возврате денежных средств либо Постоянного поручения на возврат денежных средств в порядке, определенном разделом 15 Правил клиринга.

Постоянное поручение на депонирование денежных средств направляется Участником клиринга в электронном виде с использованием Клиринговой системы, или на бумажном носителе по форме, предусмотренной приложением № 22 к Правилам клиринга, или в форме электронного документа.

Постоянное поручение на депонирование денежных средств исполняется Клиринговым центром каждый Расчетный день, начиная с первого Расчетного дня, следующего за датой предоставления указанного поручения.

Постоянное поручение на депонирование денежных средств действует до его отмены Участником клиринга.

Отмена Постоянного поручения на депонирование денежных средств осуществляется с использованием Клиринговой системы или путем направления Участником клиринга Клиринговому центру документа на бумажном носителе в свободной форме или электронного документа.

18. Порядок взимания комиссионных вознаграждений

18.1. Клиринговый центр взимает с Участников клиринга:

- комиссионное вознаграждение в пользу Клирингового центра за клиринговое обслуживание (далее – комиссионное вознаграждение Клирингового центра);
- комиссионное вознаграждение в пользу Администратора за организацию торгов;
- вознаграждение в пользу Технического центра за предоставление интегрированного технологического сервиса (ИТС), включая дополнительный комиссионный сбор за предоставление ИТС, установленный документами Технического центра (далее – Дополнительный комиссионный сбор).

18.2. Размер комиссионного вознаграждения Клирингового центра, подлежащего уплате Участником клиринга, рассчитывается Клиринговым центром в соответствии с Тарифами Клирингового центра.

18.3. Комиссионное вознаграждение Администратора за организацию торгов взимается Клиринговым центром в соответствии с действующими размерами комиссионного вознаграждения за организацию торгов, утвержденными Администратором (далее – Тарифы Администратора), на основании Договора о взаимодействии.

18.4. Вознаграждение Технического центра взимается Клиринговым центром в соответствии с действующими размерами вознаграждения за предоставление ИТС, утвержденными Техническим центром (далее – Тарифы Технического центра), на основании Договора о взаимодействии.

18.5. Участник клиринга исполняет обязательства по уплате комиссионных вознаграждений Клирингового центра, Администратора и Технического центра в российских рублях.

18.6. Размер комиссионного вознаграждения Администратора за организацию торгов,

вознаграждения Технического центра за предоставление ИТС и комиссионного вознаграждения Клирингового центра за клиринговое обслуживание по сделкам по покупке и продаже иностранной валюты и по сделкам своп рассчитывается с учетом действующего для Участника клиринга тарифного плана.

- 18.6.1. Тарифный план по сделкам по покупке и продаже иностранной валюты или по сделкам своп действует для Регистрационного кода Участника клиринга и для всех Расчетных кодов, открытых в рамках Регистрационного кода.

По умолчанию для Участника клиринга действует тарифный план «Базовый» по сделкам по покупке и продаже иностранной валюты с Датой исполнения в дату заключения сделки или в первый Расчетный день, следующий за датой заключения сделки, и тарифный план 1 (базовый) по сделкам своп и по сделкам по покупке и продаже иностранной валюты с Датой исполнения не ранее, чем на второй Расчетный день после даты заключения сделки.

- 18.6.2. Выбор Участником клиринга тарифного плана по сделкам своп и по сделкам по покупке и продаже иностранной валюты с Датой исполнения не ранее, чем на второй Расчетный день после даты заключения сделки, осуществляется путем предоставления Клиринговому центру Заявления о выборе (смене) тарифного плана по сделкам своп.

Заявление о выборе (смене) тарифного плана по сделкам своп направляется Участником клиринга в электронном виде с использованием Клиринговой системы или на бумажном носителе по форме, предусмотренной приложением № 30 к Правилам клиринга, или в форме электронного документа.

Заявление о выборе (смене) тарифного плана по сделкам своп предоставляется в Клиринговый центр не позднее, чем за 5 (пять) рабочих дней до начала календарного месяца, с которого будет применяться соответствующий тарифный план.

Тарифный план по сделкам своп и сделкам по покупке и продаже иностранной валюты с Датой исполнения не ранее, чем на второй Расчетный день после даты заключения сделки, действует для Участника клиринга до момента начала действия нового тарифного плана по сделкам своп, выбранного Участником клиринга путем предоставления нового Заявления о выборе (смене) тарифного плана по сделкам своп.

- 18.6.3. Выбор Участником клиринга тарифного плана по сделкам по покупке и продаже иностранной валюты с Датой исполнения в дату заключения сделки или в первый Расчетный день, следующий за датой заключения сделки, осуществляется путем предоставления Клиринговому центру Заявления о выборе (смене) тарифного плана по сделкам по покупке и продаже иностранной валюты.

Заявление о выборе (смене) тарифного плана по сделкам по покупке и продаже иностранной валюты направляется Участником клиринга в электронном виде с использованием Клиринговой системы или на бумажном носителе по форме, предусмотренной приложением № 33 к Правилам клиринга, или в форме электронного документа.

Заявление о выборе (смене) тарифного плана по сделкам по покупке и продаже иностранной валюты предоставляется в Клиринговый центр не позднее, чем за 5 (пять) рабочих дней до начала календарного месяца, с которого будет применяться соответствующий тарифный план.

Тарифный план по сделкам по покупке и продаже иностранной валюты с Датой

исполнения в дату заключения сделки или в первый Расчетный день, следующий за датой заключения сделки, действует для Участника клиринга до момента начала действия нового тарифного плана по сделкам по покупке и продаже иностранной валюты, выбранного Участником клиринга путем предоставления нового Заявления о выборе (смене) тарифного плана по сделкам по покупке и продаже иностранной валюты.

- 18.7. Размер оборотной части комиссионного вознаграждения Администратора за организацию торгов, оборотной части вознаграждения Технического центра за предоставление ИТС и оборотной части комиссионного вознаграждения Клирингового центра за клиринговое обслуживание по сделкам по покупке и продаже иностранной валюты и по сделкам своп рассчитывается после заключения Сделки и подлежит уплате Участником клиринга ежедневно в дату заключения Сделки в срок, установленный Регламентом.
- 18.8. Постоянная часть комиссионного вознаграждения Администратора за организацию торгов по сделкам по покупке и продаже иностранной валюты и по сделкам своп, постоянная часть вознаграждения Технического центра за предоставление ИТС по сделкам по покупке и продаже иностранной валюты и по сделкам своп и постоянная часть комиссионного вознаграждения Клирингового центра за клиринговое обслуживание по сделкам по покупке и продаже иностранной валюты и по сделкам своп подлежат уплате Участником клиринга в первый Рабочий день месяца, за который взимается постоянная часть комиссионного вознаграждения, в срок, установленный Регламентом, по Расчетному коду, указанному Участником клиринга в Заявлении о выборе Расчетного кода для списания комиссионных вознаграждений (в случае предоставления указанного заявления) либо по основному Расчетному коду, соответствующему Регистрационному коду, для которого Участником клиринга выбран тарифный план, содержащий постоянную часть комиссионного вознаграждения по сделкам по покупке и продаже иностранной валюты и/или по сделкам своп.
- Заявление о выборе Расчетного кода для списания комиссионных вознаграждений направляется Участником клиринга на бумажном носителе по форме, предусмотренной приложением № 40 к Правилам клиринга, или в форме электронного документа.
- Заявление о выборе Расчетного кода для списания комиссионных вознаграждений действует, начиная с дня, следующего за днем его предоставления.
- 18.9. В случае если для Участника клиринга действует Тарифный план «Базовый» по сделкам по покупке и продаже иностранной валюты с Датой исполнения в дату заключения сделки или в первый Расчетный день, следующий за датой заключения сделки, и по итогам месяца сумма рассчитанной оборотной части комиссионного вознаграждения Клирингового центра за клиринговое обслуживание по сделкам по покупке и продаже иностранной валюты с Датой исполнения в дату заключения сделки или в первый Расчетный день, следующий за датой заключения сделки (за исключением сделок своп), или оборотной части комиссионного вознаграждения Администратора за организацию торгов по сделкам по покупке и продаже иностранной валюты с Датой исполнения в дату заключения сделки или в первый Расчетный день, следующий за датой заключения сделки (за исключением сделок своп), или оборотной части вознаграждения Технического центра за предоставление

ИТС по сделкам по покупке и продаже иностранной валюты с Датой исполнения в дату заключения сделки или в первый Расчетный день, следующий за датой заключения сделки (за исключением сделок своп), подлежащего уплате Участником клиринга в течение истекшего месяца по всем Расчетным кодам, открытым в рамках одного Регистрационного кода, меньше, чем соответствующее минимальное ежемесячное комиссионное вознаграждение, установленное Тарифами Клирингового центра, Тарифами Администратора или Тарифами Технического центра, Участник клиринга обязан уплатить Клиринговому центру и/или Администратору и/или Техническому центру разницу между соответствующим минимальным ежемесячным комиссионным вознаграждением и суммой соответствующей рассчитанной оборотной части комиссионного вознаграждения Клирингового центра и/или Администратора и/или Технического центра по сделкам по покупке и продаже иностранной валюты с Датой исполнения в дату заключения сделки или в первый Расчетный день, следующий за датой заключения сделки (за исключением сделок своп), подлежащего уплате Участником клиринга в течение истекшего месяца (в том числе суммой равной нулю).

Указанная разница уплачивается в последний Рабочий день месяца по Расчетному коду, указанному Участником клиринга в Заявлении о выборе Расчетного кода для списания комиссионных вознаграждений, предоставленном в соответствии с пунктом 18.8 Правил клиринга (в случае предоставления указанного заявления), либо по основному Расчетному коду, соответствующему Регистрационному коду Участника клиринга, по которому зафиксировано превышение соответствующего минимального ежемесячного комиссионного вознаграждения над соответствующей рассчитанной оборотной частью комиссионного вознаграждения Клирингового центра и/или Администратора и/или Технического центра по сделкам по покупке и продаже иностранной валюты с Датой исполнения в дату заключения сделки или в первый Расчетный день, следующий за датой заключения сделки (за исключением сделок своп), подлежащего уплате Участником клиринга в течение истекшего месяца.

В случае прекращения действия Договора об оказании клиринговых услуг в течение месяца, минимальное ежемесячное комиссионное вознаграждение за клиринговое обслуживание взимается в последний Рабочий день действия указанного договора.

- 18.10. Фиксированная часть вознаграждения за предоставление ИТС подлежит уплате Участником клиринга в последний Рабочий день месяца фактического оказания услуг по предоставлению ИТС в срок, установленный Регламентом, по Расчетному коду, указанному Участником клиринга в Заявлении о выборе Расчетного кода для списания комиссионных вознаграждений, предоставленном в соответствии с пунктом 18.8 Правил клиринга (в случае предоставления указанного заявления), либо основному Расчетному коду, соответствующему Регистрационному коду.

В случае проведения Администратором торгов после 19:00 по московскому времени, фиксированная часть вознаграждения за предоставление ИТС подлежит уплате Участником клиринга в первый Рабочий день месяца, следующего за месяцем фактического оказания услуг по предоставлению ИТС.

- 18.11. Подлежащий уплате в соответствии с Тарифами Технического центра Дополнительный комиссионный сбор, рассчитанный в отношении Участника клиринга / Клиента Участника клиринга, подлежит уплате Участником клиринга в Расчетный день, по итогам которого указанное дополнительное вознаграждение рассчитано, в срок, установленный Регламентом для уплаты комиссионного

вознаграждения, по Расчетному коду, с указанием которого Участником клиринга в течение данного Расчетного дня были заключены Сделки за свой счет или за счет указанного Клиента, если такой Расчетный код – единственный, либо по Расчетному коду, указанному Участником клиринга в Заявлении о выборе Расчетного кода для списания комиссионных вознаграждений, предоставленном в соответствии с пунктом 18.8 Правил клиринга (в случае предоставления указанного заявления), либо по основному Расчетному коду, если Участником клиринга в течение данного Расчетного дня Сделки за свой счет или за счет указанного Клиента были заключены с указанием нескольких Расчетных кодов.

- 18.12. В случае если сумма комиссионного вознаграждения Клирингового центра, Администратора или Технического центра выражена в долларах США, указанная сумма пересчитывается в российские рубли по курсу доллара США к российскому рублю, установленному Банком России на дату взимания соответствующего комиссионного вознаграждения.
- 18.13. По окончании торгов и получении от Администратора выписки из реестра сделок по итогам Основной сессии ЕТС Клиринговый центр рассчитывает обязательства Участника клиринга по уплате комиссионных вознаграждений в соответствии с настоящим разделом Правил клиринга.
- 18.14. Информация о размере комиссионного вознаграждения Администратора, Технического центра и Клирингового центра, подлежащего уплате Участником клиринга в отчетную дату, указывается в Отчете о комиссионных вознаграждениях, направляемом Клиринговым центром Участникам клиринга в сроки, установленные Регламентом.
- Форма Отчета о комиссионных вознаграждениях приведена в приложении № 9 к Правилам клиринга.
- 18.15. Клиринговый центр зачитывает требование Участника клиринга к Клиринговому центру по возврату Участнику клиринга денежных средств в российских рублях, учитываемых в качестве Обеспечения Участника клиринга, с обязательством Участника клиринга по уплате комиссионных вознаграждений.
- При этом размер Обеспечения Участника клиринга в российских рублях уменьшается на сумму обязательства Участника клиринга по уплате комиссионных вознаграждений.
- 18.16. Если Обеспечения Участника клиринга в российских рублях недостаточно для исполнения обязательства Участника клиринга по уплате комиссионных вознаграждений в полном объеме, неисполненное обязательство (неисполненная часть обязательства) Участника клиринга по уплате комиссионных вознаграждений учитывается Клиринговым центром как Задолженность по комиссиям Участника клиринга перед Клиринговым центром.
- Указанная Задолженность по комиссиям должна быть погашена Участником клиринга до установленного Регламентом времени следующего Рабочего дня.
- Информация о наличии Задолженности по комиссиям и ее размере передается Участнику клиринга в составе отчета «Требование о погашении задолженности», направляемом Участнику клиринга в соответствии с пунктом 14.5 Правил клиринга.

- 18.17. Информация о размере оборотной части комиссионного вознаграждения Администратора за организацию торгов, оборотной части вознаграждения Технического центра за предоставление ИТС и оборотной части комиссионного вознаграждения Клирингового центра за клиринговое обслуживание по каждой заключенной Участником клиринга Сделке, рассчитанном Клиринговым центром, становится доступной Администратору посредством ПТК ТЦ немедленно после его расчета.
- 18.18. Клиринговый центр вправе в одностороннем порядке вносить изменения в Тарифы Клирингового центра. Клиринговый центр извещает Участников клиринга об изменениях и/или дополнениях, вносимых в Тарифы Клирингового центра, путем направления уведомлений в форме электронного документа и размещения новой редакции Тарифов Клирингового центра на Сайте Клирингового центра не позднее, чем за 5 (пять) рабочих дней до даты вступления их в силу.
- 19. Порядок урегулирования случаев неисполнения или ненадлежащего исполнения Участниками клиринга обязательств по Сделкам и Маржинальных требований**
- 19.1. Урегулирование случаев неисполнения или ненадлежащего исполнения Участниками клиринга обязательств по Сделкам с частичным обеспечением с наступившей Датой исполнения, осуществляется Клиринговым центром в ходе Дополнительных сессий ЕТС, проводимых Администратором в соответствии с Правилами ЕТС.
- 19.2. Дополнительная сессия ЕТС первого типа проводится в случае неисполнения Участником клиринга Маржинального требования в срок, установленный пунктом 14.8 Правил клиринга.
- 19.3. Дополнительная сессия ЕТС второго типа проводится в следующих случаях:
- в случае частичного неисполнения или неисполнения в полном объеме Участником клиринга своих Итоговых нетто-обязательств в иностранной валюте и/или Итогового обязательства в российских рублях;
 - в случае непогашения Участником клиринга до установленного Регламентом времени Задолженности по комиссиям, возникшей в предыдущие Расчетные дни, Задолженности по компенсационным взносам, возникшей в текущий день, и/или Задолженности по сделкам, возникшей в предыдущие Расчетные дни или текущий день, и наличия Обеспечения Участника клиринга в иностранных валютах, являющихся валютой лота для Сделок с частичным обеспечением;
 - в случае недостаточности денежных средств Клирингового центра для исполнения Итоговых нетто-требований в иностранной валюте и/или Итоговых требований в российских рублях Добросовестных участников клиринга;
 - в случае частичного неисполнения или неисполнения в полном объеме Клиринговым центром Итоговых нетто-требований Участника клиринга в иностранной валюте и/или Итогового требования Участника клиринга в российских рублях.
- 19.4. Время проведения Дополнительных сессий ЕТС определено Временным регламентом проведения торгов на Единой торговой сессии, утверждаемым Администратором.

- 19.5. В случаях, предусмотренных пунктами 19.2, 19.3 Правил клиринга, Клиринговый центр направляет Администратору уведомление о необходимости проведения Дополнительной сессии, в котором указываются:
- тип Дополнительной сессии ЕТС;
 - Регистрационный и Расчетный код Участника клиринга, в отношении которого должна быть проведена Дополнительная сессия ЕТС;
 - условия сделок, которые должны быть заключены между Клиринговым центром и Участником клиринга, включая:
 - код инструмента, направленность сделки, количество лотов и цена сделки (указываются для сделок по покупке и продаже иностранной валюты);
 - коды инструментов, по которым будет заключаться сделка своп, направленность сделки в отношении Участника клиринга, количество лотов и цену сделки своп (указываются для сделок своп).
- 19.6. Участник клиринга признает и подтверждает право Клирингового центра использовать Обеспечение данного Участника клиринга для прекращения (исполнения) обязательств данного Участника клиринга по Сделкам, заключенным в ходе Дополнительных сессий ЕТС.
- 19.7. Дополнительная сессия ЕТС первого типа в отношении Недобросовестного участника клиринга не проводится в случае, если у Недобросовестного участника клиринга отозвана (аннулирована) лицензия Банка России на осуществление банковских операций со средствами в рублях и иностранной валюте или в случае, если в отношении Недобросовестного участника клиринга действуют иные обстоятельства, предусмотренные пунктом 8.2 Правил клиринга.
- 19.8. В ходе Дополнительной сессии ЕТС первого типа между Клиринговым центром и Недобросовестным участником клиринга могут быть заключены сделки по покупке и продаже иностранной валюты, в том числе сделки своп.
- 19.9. Условия сделок, заключаемых между Клиринговым центром и Недобросовестным участником клиринга в ходе Дополнительной сессии ЕТС первого типа, формируются Клиринговым центром таким образом, чтобы заключение указанных сделок приводило к увеличению Единого лимита данного Участника клиринга.
- Указанные сделки заключаются до момента исполнения Маржинального требования Участника клиринга. Указанные сделки могут заключаться только при условии, что их заключение приводит к увеличению Единого лимита Участника клиринга, имеющего неисполненное Маржинальное требование.
- Условия сделок, заключаемых между Клиринговым центром и Недобросовестным участником клиринга в ходе Дополнительной сессии ЕТС первого типа, соответствуют условиям сделок, заключенных Клиринговым центром в соответствии с пунктом 19.24 Правил клиринга.
- 19.10. В случае наличия у Участника клиринга на момент начала Дополнительной сессии ЕТС второго типа непогашенной Задолженности по сделкам и/или Задолженности по комиссиям и/или Задолженности по компенсационным взносам, Участник клиринга обязан уплатить Клиринговому центру пеню, рассчитываемую по формуле:
- $$\text{Fine} = D \times 2 \times S \times n / 365, \text{ где}$$

Fine – сумма пени, в российских рублях,

D – сумма Задолженности по сделкам и/или Задолженности по комиссиям и/или Задолженности по компенсационным взносам, в российских рублях,

S – ставка рефинансирования, установленная Банком России на дату расчета суммы пени,

n - количество календарных дней между датой расчета суммы пени и следующим Рабочим днем,

Сумма пени, рассчитанная в соответствии с настоящим пунктом Правил клиринга при наличии Задолженности по комиссиям, включает НДС,

Сумма пени, рассчитанная в соответствии с настоящим пунктом Правил клиринга при наличии Задолженности по сделкам или Задолженности по компенсационным взносам, не облагается НДС.

- 19.11. Клиринговый центр зачитывает обязательство Участника клиринга по уплате пени, рассчитанной в соответствии с пунктом 19.10 Правил клиринга, с требованием Участника клиринга по возврату денежных средств в российских рублях, учитываемых в качестве Обеспечения Участника клиринга, за исключением случаев отзыва (аннулирования) лицензии Банка России на осуществление банковских операций со средствами в рублях и иностранной валюте в связи с банкротством Участника клиринга, созданного в соответствии с законодательством Российской Федерации.

В случае если Обеспечения Участника клиринга в российских рублях недостаточно для исполнения обязательства Участника клиринга по уплате пени, Клиринговый центр может требовать от Участника клиринга уплаты пени в судебном порядке.

- 19.12. Дополнительная сессия второго типа в отношении Участника клиринга проводится при соблюдении следующих условий:

- а) у Участника клиринга не отозвана (не аннулирована) лицензия Банка России на осуществление банковских операций со средствами в рублях и иностранной валюте;
- б) у Клирингового центра отсутствует информация об обстоятельствах в отношении Участника клиринга, перечисленных в пункте 7.1 Правил клиринга, при наступлении которых допуск к клиринговому обслуживанию Участника клиринга может быть приостановлен.

- 19.13. Условия сделок своп, заключаемых между Клиринговым центром и Недобросовестным участником клиринга в ходе Дополнительной сессии ЕТС второго типа в случае частичного неисполнения или неисполнения в полном объеме Недобросовестным участником клиринга своих Итоговых нетто-обязательств в иностранной валюте и/или Итогового обязательства в российских рублях, формируются Клиринговым центром таким образом, чтобы:

- в случае наличия у Участника клиринга неисполненного Итогового нетто-обязательства в иностранной валюте, по первой части сделки своп, заключенной в ходе Дополнительной сессии ЕТС второго типа, у Участника клиринга возникли требования в соответствующей иностранной валюте, противоположные указанному неисполненному Итоговому нетто-обязательству Участника клиринга в иностранной валюте в объеме, равном минимальной сумме, кратной установленному Правилами ЕТС для Дополнительной сессии

ЕТС лоту инструмента, превышающей указанное неисполненное Итоговое нетто-обязательство Участника клиринга в иностранной валюте;

- в случае наличия у Участника клиринга неисполненного Итогового обязательства в российских рублях, по первой части сделки своп, заключенной в ходе Дополнительной сессии ЕТС второго типа, у Участника клиринга возникли требования в российских рублях, противоположные указанному неисполненному Итоговому обязательству Участника клиринга в российских рублях, и обязательства в иностранной валюте в объеме, равном максимальной сумме, кратной установленному Правилами ЕТС для Дополнительной сессии ЕТС лоту инструмента и не превышающей суммы Итогового нетто-требования в иностранной валюте, соответствующего неисполненному Участником клиринга Итоговому обязательству в российских рублях, и размера Обеспечения Участника клиринга в соответствующей иностранной валюте.

Условия сделок своп, заключаемых между Клиринговым центром и Недобросовестным участником клиринга в ходе Дополнительной сессии ЕТС второго типа в случае наличия у Участника клиринга Задолженности, формируются Клиринговым центром таким образом, чтобы по первой части сделки своп у Участника клиринга возникли требования, противоположные Задолженности в объеме, равном максимальной сумме, кратной установленному Правилами ЕТС для Дополнительной сессии ЕТС лоту инструмента и не превышающей размера Обеспечения Участника клиринга в иностранной валюте, являющейся валютой лота для Сделок с частичным обеспечением.

- 19.14. При необходимости проведения Дополнительной сессии ЕТС второго типа в отношении Добросовестных участников клиринга в соответствии с пунктом 19.25 Правил клиринга, условия сделок своп, заключаемых между Клиринговым центром и Добросовестным участником клиринга в ходе Дополнительной сессии ЕТС второго типа в случае частичного неисполнения или неисполнения в полном объеме Клиринговым центром Итоговых нетто-требований Участника клиринга в иностранной валюте, формируются Клиринговым центром таким образом, чтобы:

- по первой части сделки своп, заключенной в ходе Дополнительной сессии ЕТС второго типа, у Участника клиринга возникли обязательства в соответствующей иностранной валюте, противоположные указанному неисполненному Итоговому нетто-требованию Участника клиринга в иностранной валюте в объеме, равном максимальной сумме, кратной установленному Правилами ЕТС для Дополнительной сессии ЕТС лоту инструмента, и не превышающей указанное неисполненное Итоговое нетто-требование Участника клиринга в иностранной валюте.

- 19.15. Базовый курс сделки своп, заключаемой в ходе Дополнительной сессии ЕТС второго типа, устанавливается равным Центральному курсу, определенному в ходе клиринговой сессии текущего Рабочего дня.

Цена сделки своп рассчитывается по следующей формуле:

$\text{Swap_Price} = K \times \text{Rc_RUB_VAL} \times S \times n / 365$, где

Swap_Price – цена сделки своп,

K – коэффициент, равный 1, в случае если направленность сделки в отношении Недобросовестного участника клиринга - «продажа», а в отношении Добросовестного участника клиринга – «покупка», или равный -1, в случае если направленность сделки

в отношении Недобросовестного участника клиринга - «покупка», а в отношении Добросовестного участника клиринга - «продажа»,

Rc_RUB_VAL – Центральный курс сделок по покупке и продаже валюты VAL за российские рубли, рассчитанный в ходе клиринговой сессии текущего Рабочего дня,

VAL – валюта лота сделки своп (иностранная валюта, являющаяся валютой лота для Сделок с частичным обеспечением),

S – ставка, установленная Клиринговым центром в соответствии с Методикой определения риск-параметров валютного рынка; ставка может быть разной для разных валют лота сделки своп,

p – количество календарных дней между датой исполнения первой и второй части сделки своп.

- 19.16. В случае невозможности исполнения Участником клиринга своих Итоговых нетто-обязательств в иностранной валюте и/или Итогового обязательства в российских рублях вследствие непреодолимой силы или сбоя в платежной системе Банка России, в ходе Дополнительной сессии ЕТС второго типа Клиринговым центром с Участником клиринга заключаются сделки своп с Ценой сделки своп, равной нулю.

Под обстоятельствами непреодолимой силы понимаются:

- военные действия, акты террора, диверсии и саботажа, массовые беспорядки, забастовки, смена политического режима и другие политические осложнения;
- изменения законодательных или иных актов государственных органов Российской Федерации, решений законодательных и исполнительных органов власти;
- пожары или иные несчастные случаи, разрушения или значительные повреждения занимаемых Участником клиринга помещений;
- любые иные обстоятельства, которые создают или могут создать угрозу жизни или здоровью работников Участника клиринга.

О возникновении обстоятельств непреодолимой силы, вследствие которых исполнение Участником клиринга своих Итоговых нетто-обязательств в иностранной валюте и/или Итогового обязательства в российских рублях невозможно, Участник клиринга обязан уведомить Клиринговый центр любыми доступными средствами связи до установленного времени проведения Дополнительной сессии ЕТС второго типа.

Участник клиринга обязан предоставить Клиринговому центру документы, подтверждающие обстоятельства непреодолимой силы в течение 7 (семи) дней. В случае непредоставления Участником клиринга Клиринговому центру таких документов в указанный срок с Участника клиринга по решению Клирингового центра взыскивается неустойка, равная Цене сделки своп, рассчитанной в соответствии с пунктом 19.13 Правил клиринга в расчете на количество календарных дней между датой исполнения первой части сделки своп и датой расчета неустойки.

Уплата Участником клиринга неустойки в соответствии с настоящим пунктом Правил клиринга не освобождает Участника клиринга от исполнения обязательств по второй части сделки своп, заключенной в ходе Дополнительной сессии ЕТС второго типа.

- 19.17. По итогам Дополнительной сессии ЕТС второго типа Клиринговый центр зачитывает встречные однородные Итоговые нетто-обязательства в иностранной валюте и/или

Итоговое обязательство в российских рублях и/или Задолженности в российских рублях Участника клиринга с требованиями в соответствующих валютах по первым частям сделок своп, заключенных в ходе данной Дополнительной сессии ЕТС Клиринговым центром с Участником клиринга, а Итоговые нетто-требования в иностранной валюте и/или Итоговое требование в российских рублях Участника клиринга с обязательствами в соответствующих валютах по первым частям сделок своп, заключенных в ходе данной Дополнительной сессии ЕТС Клиринговым центром с Участником клиринга, и направляет ему Клиринговый отчет по итогам Торговых сессий ЕТС и Дополнительной сессии ЕТС, а также Биржевое свидетельство по итогам Торговых сессий ЕТС и Дополнительной сессии ЕТС.

Биржевое свидетельство по итогам Торговых сессий ЕТС, направленное Участнику клиринга, утрачивает силу с момента направления ему Клиринговым центром Биржевого свидетельства по итогам Торговых сессий ЕТС и Дополнительной сессии ЕТС.

Форма Клирингового отчета по итогам Торговых сессий ЕТС и Дополнительной сессии ЕТС приведена в приложении № 26 к Правилам клиринга.

Форма Биржевого свидетельства по итогам Торговых сессий ЕТС и Дополнительной сессии ЕТС приведена в приложении № 8 к Правилам клиринга.

- 19.18. Клиринговый центр зачитывает Итоговое нетто-обязательство Участника клиринга в иностранной валюте и/или Итоговое обязательство Участника клиринга в российских рублях, указанное в Биржевом свидетельстве по итогам Торговых сессий ЕТС и Дополнительной сессии ЕТС, предоставленном Участнику клиринга, с требованием Участника клиринга по возврату денежных средств в соответствующей валюте, учитываемых в качестве Обеспечения Участника клиринга.

При этом размер Обеспечения Участника клиринга в соответствующей валюте уменьшается на сумму исполненного Итогового нетто-обязательства / Итогового обязательства.

- 19.19. Итоговое обязательство в российских рублях Участника клиринга, не прекращенные после проведения указанного в пункте 19.18 Правил клиринга зачета, учитываются Клиринговым центром как Задолженность по сделкам Участника клиринга перед Клиринговым центром.

Указанная Задолженность по сделкам должна быть погашена Участником клиринга не позднее установленного Регламентом времени Рабочего дня, следующего за днем возникновения указанной задолженности.

Информация о наличии у Участника клиринга Задолженности по сделкам и ее размере передается Участнику клиринга в составе отчета «Требование о погашении Задолженности», направляемом Участнику клиринга в соответствии с пунктом 14.5 Правил клиринга.

- 19.20. Если Задолженность Участника клиринга, внесшего взнос в Фонд в размере, установленном пунктом 2.15 Правил клиринга, перед Клиринговым центром не погашена в установленные Регламентом сроки, Клиринговый центр использует средства Фонда в порядке, определенном разделом 20 Правил клиринга.

- 19.20.1. Клиринговый центр может требовать от Участника клиринга погашения его Задолженности в судебном порядке.

- 19.21. Итоговые нетто-требования в иностранной валюте и/или Итоговое требование в российских рублях Участника клиринга, указанные в Биржевом свидетельстве по итогам Торговых сессий ЕТС и Дополнительной сессии ЕТС, предоставленном Участнику клиринга, прекращаются возникновением обязательства Клирингового центра по возврату Участнику клиринга денежных средств в соответствующей валюте, учитываемых в качестве Обеспечения Участника клиринга, в размере Итогового нетто-требования в иностранной валюте и/или Итогового требования в российских рублях.

При этом размер Обеспечения Участника клиринга в соответствующей валюте увеличивается на сумму прекращенного Итогового нетто-требования / Итогового требования Участника клиринга в этой валюте.

Возврат денежных средств Участнику клиринга по итогам Дополнительной сессии ЕТС второго типа не производится.

- 19.22. Обязательства / требования в соответствующих валютах по вторым частям сделок своп, заключенных в ходе Дополнительной сессии ЕТС второго типа Клиринговым центром с Участником клиринга, учитываются в составе Нетто-обязательств / Нетто-требований Участника клиринга с Датой исполнения, соответствующей дате исполнения обязательств по вторым частям указанных сделок своп, в порядке, определенном разделом 10 Правил клиринга.

- 19.23. При наличии у Клирингового центра информации об обстоятельствах в отношении Недобросовестного участника клиринга, перечисленных в пункте 7.1 Правил клиринга, в соответствии с которыми допуск к клиринговому обслуживанию Недобросовестного участника клиринга будет приостановлен в следующий Торговый день, неисполненные обязательства Участника клиринга по Сделкам, в том числе с ненаступившей Датой исполнения, прекращаются выплатой неустойки.

- 19.23.1. Неустойка, уплачиваемая Недобросовестным участником клиринга Клиринговому центру, рассчитывается по одной из следующих формул:

$\text{Penalty} = |S| + |F|$, если $S < 0$;

$\text{Penalty} = |F|$, если $S \geq 0$, где

Penalty - сумма неустойки, в российских рублях,

$S = \sum_i (\sum_j (\text{OBL_VAL}_{ij} \times (\text{Rc_RUB_VAL}_j + \text{SWAPCRate_VAL}_{ij})) + \text{OBL_RUB}_i) + \text{RET_RUB}$,

$F = \sum_i \sum_j F_VAL_{ij} + F_RUB_i$,

OBL_VAL_{ij} - неисполненное Нетто-обязательство / Нетто-требование Участника клиринга в иностранной валюте VAL_j с i -ой Датой исполнения,

OBL_RUB_i - неисполненное Нетто-обязательство / Нетто-требование Участника клиринга в российских рублях с i -ой Датой исполнения,

Нетто-обязательство учитывается со знаком «минус», Нетто-требование – со знаком «плюс»,

F_VAL_{ij} - составляющая неустойки, рассчитываемая за неисполнение Участником клиринга Нетто-обязательства в иностранной валюте VAL_j с i -ой Датой исполнения, в случае, если $\text{OBL_VAL}_{ij} < 0$;

$F_VAL_{ij} = \text{OBL_VAL}_{ij} \times (\text{Rc_RUB_VAL}_j + \text{SWAPCRate_VAL}_{ij}) \times K$,

F_RUB_i - составляющая неустойки, рассчитываемая за неисполнение Участником клиринга Нетто-обязательства в российских рублях с i -ой Датой исполнения, в случае, если $OBL_RUB_i < 0$;

$F_RUB_i = OBL_RUB_i \times K$,

$Rc_RUB_VAL_j$ – Центральный курс сделок по покупке и продаже иностранной валюты VAL_j за российские рубли, рассчитанный в ходе клиринговой сессии текущего Расчетного дня,

$SWAPCRate_VAL_{ij}$ - центральное значение Индикативного курса сделок своп, установленного в текущий день для i -ой Даты исполнения и иностранной валюты VAL_j за российские рубли. Для Даты исполнения в Расчетный день, следующий за текущим, значение $SWAPCRate_VAL_i$ равно нулю,

VAL_j –валюта, являющейся валютой лота для Сделок с частичным обеспечением,

RET_RUB – размер неисполненного обязательства по возврату Компенсационных взносов (с учетом знака),

$\sum_i$ – сумма по Датам исполнения,

$\sum_j$ - сумма по валютам VAL_j ,

K – ставка неустойки, в долях единицы, устанавливаемая решением Клирингового центра.

- 19.23.2. Клиринговый центр зачитывает обязательство Участника клиринга по уплате неустойки, рассчитанной в соответствии с подпунктом 19.23.1 Правил клиринга, с требованием Участника клиринга по возврату денежных средств в российских рублях, учитываемых в качестве Обеспечения Участника клиринга.

В случае если Обеспечения Участника клиринга в российских рублях недостаточно для исполнения обязательства Участника клиринга по уплате неустойки, Клиринговый центр может требовать от Участника клиринга уплаты неустойки в судебном порядке.

- 19.23.3. Требование Участника клиринга по получению неустойки, рассчитанной в соответствии с подпунктом 19.23.1 Правил клиринга, увеличивает размер требования Участника клиринга по возврату денежных средств в российских рублях, учитываемых в качестве Обеспечения Участника клиринга.

- 19.24. В случае заключения Клиринговым центром сделок по покупке и продаже иностранной валюты с Недобросовестным участником клиринга, имеющим неисполненное Маржинальное требование, в соответствии с настоящим разделом Правил клиринга, а также в случаях прекращения обязательств Недобросовестного участника клиринга в соответствии с пунктом 19.23 Правил клиринга или прекращения обязательств по Сделкам в соответствии с пунктами 7.7-8.2 Правил клиринга, Клиринговый центр вправе в соответствии с пунктом 13.9 Правил клиринга в ходе Торговых сессий ЕТС сформировать в ТС подтверждение УКО, содержащее определенное Клиринговым центром значение объема заключаемой Сделки.

- 19.25. При наличии Недобросовестных участников клиринга, не исполнивших полностью или частично свои Итоговые нетто-обязательства в иностранной валюте и/или Итоговые обязательства в российских рублях, рассчитанные по Сделкам с частичным обеспечением, для исполнения Итоговых нетто-требований в иностранной валюте и/или Итоговых требований в российских рублях Добросовестных участников клиринга Клиринговый центр осуществляет действия в следующей

последовательности:

- использует собственные денежные средства;
- в случае недостаточности собственных денежных средств в ходе Дополнительной сессии ЕТС второго типа заключает сделки своп с Уполномоченными участниками торгов ЕТС, за исключением Банка России;
- в случае невозможности заключения сделок своп с Уполномоченными участниками торгов ЕТС, за исключением Банка России, заключает в соответствии с Договором о взаимодействии сделки своп с Банком России в ходе Дополнительной сессии ЕТС второго типа;
- в случае невозможности заключения сделок своп с Уполномоченными участниками торгов ЕТС, включая Банк России, уведомляет Администратора о необходимости проведения Дополнительной сессии ЕТС второго типа в отношении Добросовестных участников клиринга.

19.25.1. Базовый курс и цена сделки своп, заключаемой Клиринговым центром с Уполномоченным участником торгов ЕТС, за исключением Банка России, определяются в соответствии с договором, заключенным Клиринговым центром с соответствующим Уполномоченным участником торгов ЕТС.

19.25.2. По итогам Дополнительной сессии ЕТС второго типа Клиринговый центр зачитывает встречные однородные Итоговые нетто-обязательства в иностранной валюте и/или Итоговое обязательство в российских рублях / Итоговые нетто-требования в иностранной валюте и/или Итоговое требование в российских рублях Уполномоченных участников торгов ЕТС, за исключением Банка России, с обязательствами / требованиями по первым частям сделок своп, заключенных в ходе данной Дополнительной сессии ЕТС Клиринговым центром с таким Уполномоченным участником торгов ЕТС, и направляет ему Клиринговый отчет по итогам Торговых сессий ЕТС и Дополнительной сессии ЕТС, а также Биржевое свидетельство по итогам Торговых сессий ЕТС и Дополнительной сессии ЕТС.

19.26. Порядок исполнения (прекращения) Итоговых нетто-обязательств в иностранной валюте и/или Итоговых обязательств в российских рублях / Итоговых нетто-требований в иностранной валюте и/или Итоговых требований в российских рублях с обязательствами / требованиями Уполномоченных участников торгов ЕТС, за исключением Банка России, по итогам Дополнительной сессии ЕТС второго типа, определен пунктами 19.18, 19.21 Правил клиринга, порядок учета обязательств / требований Уполномоченных участников торгов ЕТС по вторым частям сделок своп, заключенных в ходе Дополнительной сессии ЕТС второго типа Клиринговым центром с таким Уполномоченным участником торгов ЕТС, пунктом 19.22 Правил клиринга.

19.27. Порядок взаимодействия Администратора, Клирингового центра и Банка России в ходе проведения Дополнительных сессий ЕТС второго типа, а также условия сделок своп с Банком России и порядок их исполнения, определены Договором о взаимодействии.

19.28. В случае изменении условий обращения иностранной валюты, включенной в Перечень инструментов, с которыми заключаются Сделки с частичным обеспечением, Клиринговый центр вправе:

- исключить такую иностранную валюту из Перечня инструментов, с которыми

закljučаются Сделки с частичным обеспечением;

- прекратить обязательства Участников клиринга и Клирингового центра в такой иностранной валюте выплатой отступного, сумма которого рассчитывается по формуле:

$Penalty = |S|$, где

Penalty – сумма отступного, в российских рублях,

$S = OBL_VAL \times Rc_RUB_VAL + OBL_RUB$,

OBL_VAL - неисполненное Нетто-обязательство / Нетто-требование Участника клиринга в иностранной валюте VAL, обязательства в которой прекращаются выплатой отступного,

OBL_RUB - неисполненное Нетто-обязательство / Нетто-требование Участника клиринга в российских рублях, соответствующее Нетто-требованию / Нетто-обязательству Участника клиринга в иностранной валюте VAL, обязательства в которой прекращаются выплатой отступного,

Нетто-обязательство учитывается со знаком «минус», Нетто-требование со знаком «плюс»,

Rc_RUB_VAL – Центральный курс сделок по покупке и продаже иностранной валюты VAL, обязательства в которой прекращаются выплатой отступного, рассчитанный в ходе клиринговой сессии текущего Расчетного дня.

Если $S < 0$, отступное, рассчитанное в соответствии с настоящим подпунктом Правил клиринга уплачивает Участник клиринга Клиринговому центру,

если $S > 0$, Клиринговый центр - Участнику клиринга.

20. Порядок использования и возмещения Фонда

20.1. Клиринговый центр использует средства Фонда для исполнения обязательств любого из Участников клиринга, внесших взносы в Фонд в размере, установленном пунктом 2.15 Правил клиринга, по Сделкам с наступившей Датой исполнения в случае, если Задолженность такого Участника клиринга перед Клиринговым центром не погашена в установленные Регламентом сроки.

20.2. В первую очередь используется взнос в Фонд Недобросовестного участника клиринга, во вторую – взносы в Фонд Добросовестных участников клиринга.

Взносы в Фонд Добросовестных участников клиринга используются в случае, если сумма Задолженностей Недобросовестных участников клиринга перед Клиринговым центром, пересчитанная в доллары США по курсу, установленному Банком России на дату использования средств Фонда, превышает 18 000 000 (восемнадцать миллионов) долларов США.

20.3. Взнос в Фонд Недобросовестного участника клиринга используется для удовлетворения требований Клирингового центра по Задолженности Недобросовестного участника клиринга путем продажи Клиринговым центром долларов США, составляющих взнос в Фонд Недобросовестного участника клиринга, за российские рубли по курсу, равному Нижней границе диапазона оценки рисков сделок по покупке и продаже долларов США за российские рубли, установленной на дату удовлетворения требований.

Удовлетворение требований за счет вноса в Фонд Недобросовестного участника клиринга осуществляется Клиринговым центром без предварительного уведомления Недобросовестного участника клиринга.

Сумма, полученная по указанной конверсионной сделке засчитывается Клиринговым центром в счет погашения Задолженности Недобросовестного участника клиринга.

Внос в Фонд Недобросовестного участника клиринга уменьшается на сумму использованных средств Фонда из вноса Недобросовестного участника клиринга.

20.4. Вносы в Фонд Добросовестных участников клиринга используются в размере превышения суммы Задолженностей Недобросовестных участников клиринга пересчитанной в доллары США по курсу, установленному Банком России на дату использования средств Фонда, величины, установленной пунктом 20.2 Правил клиринга.

20.4.1. Использование взносов в Фонд Добросовестных участников клиринга осуществляется пропорционально размеру вноса в Фонд каждого Участника клиринга.

20.4.2. Внос в Фонд Добросовестного участника клиринга используется для удовлетворения требований Клирингового центра по Задолженности Недобросовестного участника клиринга путем продажи Клиринговым центром долларов США, составляющих внос в Фонд Добросовестного участника клиринга, за российские рубли по курсу, равному Нижней границе диапазона оценки рисков сделок по покупке и продаже долларов США за российские рубли, установленной на дату удовлетворения требований.

Удовлетворение требований за счет вноса в Фонд Добросовестного участника клиринга осуществляется Клиринговым центром без предварительного уведомления Добросовестного участника клиринга.

Сумма, полученная по указанной конверсионной сделке засчитывается Клиринговым центром в счет погашения Задолженности Недобросовестного участника клиринга.

Внос в Фонд Добросовестного участника клиринга уменьшается на сумму использованных средств Фонда из вноса Добросовестного участника клиринга.

20.5. В случае полного или частичного использования вноса в Фонд Участника клиринга, Клиринговый центр вправе с рабочего дня, следующего за днем использования Фонда, уменьшить Лимит, обеспеченный средствами фонда, такого Участника клиринга, в том числе установить равным нулю, в порядке, определенном Методикой лимитирования операций на валютном рынке.

20.6. В случае использования взносов в Фонд Добросовестных Участников клиринга, Недобросовестный участник клиринга обязан в течение 2 (двух) рабочих дней возместить использованные средства Фонда.

Уведомление о необходимости возмещения средств Фонда, содержащее информацию о сумме использованных средств Фонда, подлежащей возмещению Участником клиринга, о реквизитах счета для возмещения средств Фонда, о сроке, в течение которого средства Фонда должны быть возмещены, направляется Участнику клиринга в форме электронного документа не позднее рабочего дня, следующего за датой использования Фонда.

20.7. После возмещения Недобросовестным участником клиринга использованных средств Фонда, Клиринговый центр возмещает использованные взносы в Фонд

Добросовестных участников клиринга.

Если полученных от Недобросовестного участника клиринга денежных средств недостаточно для полного возмещения взносов в Фонд Добросовестных участников клиринга, осуществляется частичное возмещение таких взносов в размере, пропорциональном сумме использованных средств Фонда из взноса каждого Участника клиринга.

При этом размер взноса в Фонд Добросовестного участника клиринга и размер обязательства Клирингового центра по возврату Участнику клиринга взноса в Фонд увеличиваются на сумму возмещенных денежных средств.

- 20.8. В случае использования взносов в Фонд Добросовестных участников клиринга и невозмещения Недобросовестным участником клиринга использованных средств Фонда в течение 2 (двух) рабочих дней после их использования, Добросовестные участники клиринга обязаны восполнить свои взносы в Фонд до размера, установленного Клиринговым центром в соответствии с пунктом 2.15 Правил клиринга. Указанная обязанность по восполнению взноса в Фонд не может возникать у Добросовестного участника клиринга чаще, чем один раз в Расчетный день.

Клиринговый центр информирует Добросовестных участников клиринга о необходимости восполнения их взносов в Фонд путем направления соответствующих уведомлений.

21. Взаимодействие с Администратором при возникновении обстоятельств, которые могут повлиять на возможность проведения торгов

- 21.1. В случае возникновения обстоятельств, вызывающих и/или создающих предпосылки к возникновению сбоев (отказов) при эксплуатации Клиринговой системы и/или непосредственно препятствующие ее нормальному (штатному) функционированию (в том числе, обстоятельства непреодолимой силы, а также сбои, неисправности и отказы оборудования; сбои и ошибки программного обеспечения; сбои, неисправности и отказы систем связи, энергоснабжения, кондиционирования и других систем жизнеобеспечения, а также иные обстоятельства, такие как случаи нарушения правил разграничения доступа и/или попыток несанкционированного доступа к Клиринговой системе), Клиринговый центр незамедлительно уведомляет об этом Администратора любым из доступных средств связи и предпринимает все возможные меры, направленные на устранение указанных обстоятельств.

22. Чрезвычайные ситуации

- 22.1. Чрезвычайной ситуацией может быть признана ситуация, связанная с наступлением обстоятельств, препятствующих клиринговому обслуживанию Участников клиринга, в том числе:
- обстоятельства, вызывающие и/или создающие предпосылки к возникновению сбоев (отказов) при эксплуатации Клиринговой системы и/или непосредственно препятствующие ее нормальному (штатному) функционированию (в том числе, обстоятельства непреодолимой силы, а также сбои, неисправности и отказы оборудования; сбои и ошибки программного обеспечения; сбои, неисправности и отказы систем связи, энергоснабжения, кондиционирования и других систем жизнеобеспечения, а также иные обстоятельства, такие как случаи нарушения

правил разграничения доступа и/или попыток несанкционированного доступа к Клиринговой системе), последствия которых не устранены в течение 30-ти минут после окончания установленного Регламентом времени исполнения Участниками клиринга своих Итоговых нетто-обязательств перед Клиринговым центром;

- военные действия, акты террора, диверсии и саботажа, массовые беспорядки, забастовки, смена политического режима и другие политические осложнения;
- изменения законодательных или иных актов государственных органов Российской Федерации, решений законодательных и исполнительных органов власти;
- пожары или иные несчастные случаи, разрушения или значительные повреждения занимаемых Клиринговым центром помещений;
- любые иные обстоятельства, которые создают или могут создать угрозу жизни или здоровью работников Клирингового центра.

22.2. Признание ситуации чрезвычайной осуществляется по решению Клирингового центра.

22.3. В случае признания Клиринговым центром возникшей ситуации чрезвычайной, Клиринговый центр предпринимает следующие действия:

- извещает Банк России имеющимися доступными средствами связи о возникновении чрезвычайной ситуации и о мерах, необходимых, по мнению Клирингового центра, для ее устранения;
- извещает Администратора имеющимися доступными средствами связи о возникновении чрезвычайной ситуации и о мерах, необходимых, по мнению Клирингового центра, для ее устранения;
- извещает Участников клиринга имеющимися у Клирингового центра и доступными ему в данной ситуации средствами о возникновении чрезвычайной ситуации и предпринимаемых в связи с этим действиях;
- на основании решения Клирингового центра, согласованного (если таковое согласование с учетом сложившихся обстоятельств было возможным) с Банком России и, при необходимости, с Администратором, не осуществляет клиринговое обслуживание Участников клиринга.

22.4. В качестве мер по урегулированию чрезвычайной ситуации Клиринговый центр по согласованию с Банком России и Администратором Клиринговым центром могут быть приняты следующие решения:

- об утрате силы Биржевых свидетельств, полученных Участниками клиринга в день возникновения чрезвычайной ситуации;
- об изменении способа и срока исполнения обязательств Участниками клиринга по итогам Торговых сессии ЕТС;
- об осуществлении иных действий, направленных на урегулирование чрезвычайной ситуации.

22.5. При принятии решений по урегулированию чрезвычайных ситуаций, Клиринговый центр по согласованию с Администратором вправе:

- устанавливать сроки и порядок исполнения своих решений Участниками клиринга;
- обуславливать порядок вступления в силу своих решений определенными обстоятельствами.

22.6. О мерах, предпринятых по решению Клирингового центра в целях урегулирования чрезвычайной ситуации, Банк России, Участники клиринга и Администратор оповещаются имеющимися доступными средствами связи не позднее дня принятия данных мер.

22.7. Клиринговый центр не несет ответственности за убытки, которые могут возникнуть в связи с неосуществлением клирингового обслуживания Участников клиринга в соответствии с Правилами клиринга в случае признания ситуации чрезвычайной в связи с обстоятельствами, предусмотренными пунктом 22.1 Правил клиринга.

23. Порядок разрешения споров

23.1. Все споры и разногласия, возникающие в связи с применением, нарушением, толкованием Правил клиринга, исполнением обязательств, вытекающих из Правил клиринга, признанием недействительными Правил клиринга или их части, подлежат рассмотрению и разрешению в Арбитражной комиссии при ОАО ММВБ-РТС в соответствии с документами, определяющими ее правовой статус и порядок разрешения споров, действующими на момент подачи искового заявления.

23.2. Решения Арбитражной комиссии при ОАО ММВБ-РТС являются окончательными и обязательными для исполнения. Неисполненное добровольно решение Арбитражной комиссии при ОАО ММВБ-РТС подлежит принудительному исполнению в соответствии с законодательством Российской Федерации или законодательством страны места принудительного исполнения и/или международными соглашениями.

Приложение № 1

к Правилам осуществления клиринговой деятельности Акционерным
Коммерческим Банком «Национальный Клиринговый Центр» (Закрытое
акционерное общество) при проведении Единой торговой сессии

МЕТОДИКА ОПРЕДЕЛЕНИЯ ЦЕНТРАЛЬНОГО КУРСА

- 1) Центральные курсы определяются по состоянию на 19:00 по московскому времени.
- 2) Центральный курс Сделок с частичным обеспечением рассчитывается по соответствующим Сделкам со сроком исполнения в Расчетный день, следующий за датой заключения сделки, исключая внесистемные Сделки, сделки своп и сделки по покупке и продаже долларов США за российские рубли, евро за российские рубли, входящие в сделку по инструменту «Бивалютная корзина за российские рубли».
Центральный курс Сделок с полным обеспечением рассчитывается по соответствующим Сделкам со сроком исполнения в дату заключения сделки, исключая внесистемные Сделки.
Центральный курс сделок по инструменту «Бивалютная корзина за российские рубли» рассчитывается как сумма произведения Центрального курса сделок по покупке и продаже долларов США за российские рубли на установленную Администратором долю денежных средств в долларах США в инструменте «Бивалютная корзина за российские рубли» и произведения Центрального курса сделок по покупке и продаже евро за российские рубли на установленную Администратором долю денежных средств в евро в инструменте «Бивалютная корзина за российские рубли».
- 3) Центральный курс устанавливается равным:
 - средневзвешенному курсу, рассчитанному по всем соответствующим Сделкам, заключенным в течение последних 30 (тридцати) минут торгов текущего дня, в случае если в течение этого периода времени было заключено более, чем 20 (двадцать) соответствующих Сделок;
 - средневзвешенному курсу, рассчитанному по 20 (двадцати) последним заключенным в ходе торгов соответствующим Сделкам, в случае если в течение последних 30 (тридцати) минут торгов текущего дня было заключено не более, чем 20 (двадцать) соответствующих Сделок;
 - средневзвешенному курсу, рассчитанному по всем соответствующим Сделкам, заключенным в течение текущего Торгового дня, в случае если в течение текущего Торгового дня было заключено менее, чем 20 (двадцать) соответствующих Сделок;
 - значению, определенному Клиринговым центром на основании собственной экспертной оценки, в случае если в течение текущего Торгового дня не было заключено ни одной соответствующей Сделки.

Приложение № 2

к Правилам осуществления клиринговой деятельности Акционерным
Коммерческим Банком «Национальный Клиринговый Центр» (Закрытое
акционерное общество) при проведении Единой торговой сессии

АНКЕТА УЧАСТНИКА КЛИРИНГА (КЛИЕНТА) (РЕГИСТРАЦИОННАЯ КАРТОЧКА)

«__» _____ 20__ г.
(дата заполнения)

1.*	Полное наименование организации (из Устава)	
2.*	Сокращенное наименование организации (из Устава)	
3*.	Полное наименование организации на иностранном языке (из Устава, в случае отсутствия - применяемое на практике)	
4*.	Сокращенное наименование организации на иностранном языке (из Устава, в случае отсутствия - применяемое на практике)	
5.*	Организационно-правовая форма	
6.*	Коды форм Федерального государственного статистического наблюдения:	
6.1.*	ОКПО	
6.2.*	ОКВЭД	
6.3.*	ОКОГУ	
6.4.*	ОКФС	
6.5.*	ОКОПФ	
6.6*.	ОКАТО	
7*.	Сведения о государственной регистрации: дата, номер, наименование регистрирующего органа, место регистрации	
8.*	ИНН (или код иностранной организации – для нерезидента)	
	КПП	
	КПП 2 (указывается крупнейшими налогоплательщиками - при наличии)	
9*.	БИК	
10.	SWIFT-код	
11.*	Место нахождения по Уставу	
12*.	Фактический адрес	
13.*	Почтовый адрес (для направления корреспонденции)	
14.*	Телефон	
15.*	Факс	
16.*	Адрес электронной почты	
17.*	Адрес представительства организации в Интернете	
18*.	Сведения об органах юридического лица (структура и персональный состав органов управления юридического лица)	
19*.	Сведения о величине зарегистрированного и оплаченного уставного (складочного) капитала или величине уставного фонда, имущества	
20*.	Сведения о присутствии или отсутствии по своему местонахождению юридического лица, его постоянно действующего органа управления, иного органа или лица, которые имеют право действовать от имени юридического лица без доверенности	
21*.	Количество филиалов	

22.	Для региональной организации - Московский филиал (представительство):	
	почтовый адрес	
	телефон	
	Ф.И.О. руководителя (полностью)	
	должность руководителя	
23.*	Лицензии на осуществление профессиональной деятельности (номер, кем и когда выданы с указанием видов деятельности, срок действия лицензии):	
23.1.*	На осуществление банковских операций	
23.2.*	Профессионального участника рынка ценных бумаг:	
	Брокерская	
	Дилерская	
	Управление ценными бумагами	
	Депозитарная	
23.3.*	На совершение товарных фьючерсных и опционных сделок в биржевой торговле (биржевого посредника)	
23.4.*	Лицензия на заключение биржевым посредником в биржевой торговле договоров, являющихся производными финансовыми инструментами, базисным активом которых является биржевой товар	
23.5*.	На осуществление деятельности, подлежащей лицензированию, не указанной в пп.23.1-23.3.	
24.*	Единоличный исполнительный орган организации (далее – руководитель организации):	
	Ф.И.О. (полностью)	
	должность	
	документ о назначении на должность (наименование, дата, номер)	
24.1.*	Сведения о действующих квалификационных аттестатах руководителя организации:	
	дата и номер протокола решения экзаменационной комиссии	
	дата и номер протокола решения Аттестационной комиссии	
	серия и номер квалификационного аттестата	
	присвоенная квалификация	
25.*	Контролер организации:	
	Ф.И.О. (полностью)	
	должность	
	документ о назначении на должность (название, дата, номер)	
25.1.*	Сведения о действующих квалификационных аттестатах контролера организации:	
	дата и номер протокола решения экзаменационной комиссии	
	дата и номер протокола решения Аттестационной комиссии	
	серия и номер квалификационного аттестата	
	присвоенная квалификация	
26*.	Сведения о наличии (отсутствии) корреспондентских счетов, открытых в банках государств (территорий), о которых известно, что они не соблюдают общепринятых стандартов в борьбе с легализацией (отмыванием) доходов, полученных преступным путем, и финансированием терроризма, или являются иностранными государствами (иностранскими территориями) с повышенным уровнем коррупции (если «имеются», то перечислить страны).	
27*.	Сведения о наличии (отсутствии) корреспондентских счетов, открытых в банках государств (на территориях), предоставляющих льготный налоговый режим и (или) не	

	предусматривающих раскрытие и предоставление информации при проведении финансовых операций (оффшорных зонах) (если «имеются», то перечислить страны)	
28*.	Сведения о наличии (отсутствии) корреспондентских счетов, открытых в банках государств или территорий, о которых из международных источников известно, что в них незаконно производятся или переправляются наркотические вещества, а также государств или территорий, разрешающих свободный оборот наркотических веществ (кроме государств или территорий, использующих наркотические вещества исключительно в медицинских целях) (если «имеются», то перечислить страны).	
29*.	Сведения о наличии (отсутствии) счетов, открытых «банкам-оболочкам» («банк-оболочка» - банк, зарегистрированный под юрисдикцией государства, в котором у данного банка нет представительства). Если имеются открытые счета «банкам-оболочкам», то указать их полное наименование и реквизиты счетов.	
30*.	Контактные лица:	
30.1*.	Сотрудники, курирующие вопросы осуществления операций:	
	Ф.И.О.(полностью)	
	должность	
	контактные телефоны	
	адрес электронной почты	
31*.	Сведения об осуществлении мероприятий по противодействию легализации (отмыванию) доходов, полученных преступным путем, и финансированию терроризма	

Должность

(руководитель организации или иное (Ф. И. О.)
уполномоченное лицо)¹

М.П.

Исполнитель, тел.

(ФИО, номер телефона исполнителя
регистрационной карточки)

* - пункты, обязательные для заполнения.

Пункты 24.1, 25, 25.1 не являются обязательными для заполнения Участниками клиринга, являющимися участниками клиринга только в соответствии с Правилами осуществления клиринговой деятельности Акционерным Коммерческим Банком «Национальный Клиринговый Центр» (Закрытое акционерное общество) при проведении Единой торговой сессии.

¹ Если лицо, подписавшее Анкету Участника клиринга (клиента) (Регистрационную карточку), действует на основании доверенности, то к настоящей Анкете Участника клиринга (клиента) (Регистрационной карточке) должна быть приложена нотариально удостоверенная копия указанной доверенности, подтверждающей полномочия лица на подписание Анкеты Участника клиринга (клиента) (Регистрационной карточки).

Приложение № 3

к Правилам осуществления клиринговой деятельности Акционерным
Коммерческим Банком «Национальный Клиринговый Центр» (Закрытое
акционерное общество) при проведении Единой торговой сессии

(На бланке организации)

ПЕРЕЧЕНЬ ПЛАТЕЖНЫХ РЕКВИЗИТОВ

(полное наименование Организации)

**в иностранной валюте и российских рублях
для проведения расчетов через**

(наименование Расчетного центра)

<Регистрационный код>

<Расчетный код>

Наименование банка - корреспондента	Реквизиты Корреспондентского/расчетного счета
В российских рублях:	
Наименование Банка получателя*	Наименование получателя БИК ИНН/КПП К/с Л/с
В иностранной валюте:	
Наименование Банка корреспондента Свифт – код Номер счета Банка корреспондента в Банке посреднике (если есть необходимость) Наименование Банка посредника Свифт – код	Наименование получателя на английском языке Свифт – код и/или номер счета
Свифт – код для получения отчетов по Свифт**	

(Должность руководителя)

М.П.

_____/Ф.И.О./

« ____ » _____ 20 ____ год.

Исполнитель Ф.И.О., телефон _____

* В случае если получателем услуг по Договору об оказании клиринговых услуг является филиал кредитной организации (Государственной корпорации) или получателем средств является филиал кредитной организации (Государственной корпорации), в обязательном порядке необходимо указание полного наименования данного филиала.

** Заполняется в случае, если Организация намерена получать отчеты по Свифт.

Приложение № 4

к Правилам осуществления клиринговой деятельности Акционерным
Коммерческим Банком «Национальный Клиринговый Центр» (Закрытое
акционерное общество) при проведении Единой торговой сессии

(На бланке организации)

Доверенность № _____

г. _____ “ ____ ” _____ 20__ г.

(наименование организации - Участника клиринга)

в лице _____

(должность, Фамилия, Имя, Отчество)

действующе _____ на основании* _____

(наименование документа и его реквизиты)

уполномочивает:

1. _____

(Фамилия, Имя, Отчество представителя)

паспорт номер _____, выдан _____

(кем и когда выдан)

Образец подписи _____

2. _____

(Фамилия, Имя, Отчество представителя)

паспорт номер _____, выдан _____

(кем и когда выдан)

Образец подписи _____

предоставлять и получать документы (включая отчетные документы) в ЗАО АКБ «Национальный Клиринговый Центр», оформляемые в соответствии с внутренними документами ЗАО АКБ «Национальный Клиринговый Центр», регламентирующими проведение операций, связанных с заключением сделок на биржевых рынках ОАО Московская Биржа, а также осуществлением клиринга по заключенным сделкам.

Подпись(и) вышеуказанного(ых) уполномоченного(ых) лиц(а) удостоверяю.

Настоящая доверенность выдана без права передоверия и действительна по «__»_____ 20__ г. включительно.

Контактный телефон: _____

Подпись _____

(занимаемая должность и Ф.И.О. лица, выдавшего Доверенность)

М.П.

* в случае выдачи доверенности лицом, действующим не на основании Устава, доверенность должна быть нотариально удостоверена (статья 187 Гражданского кодекса Российской Федерации)

Приложение № 5

к Правилам осуществления клиринговой деятельности Акционерным
Коммерческим Банком «Национальный Клиринговый Центр» (Закрытое
акционерное общество) при проведении Единой торговой сессии

(На бланке организации)

ЗАЯВЛЕНИЕ
на участие в Фонде покрытия рисков

Регистрационный код Участника клиринга (при наличии) _____

Просим рассмотреть возможность участия

(полное наименование организации)

в Фонде покрытия рисков ЗАО АКБ «Национальный Клиринговый Центр» (далее – Фонд).

Участник клиринга обязуется внести взнос в Фонд в размере, установленном решением ЗАО АКБ «Национальный Клиринговый Центр», в порядке, установленном Правилами осуществления клиринговой деятельности Акционерным Коммерческим Банком «Национальный Клиринговый Центр» (Закрытое акционерное общество) при проведении Единой торговой сессии (далее – Правила клиринга), а также соблюдать иные требования Правил клиринга к порядку формирования, использования и возмещения средств Фонда.

(Должность руководителя)

_____ / Ф.И.О. /

М.П.

« ____ » _____ 20 ____ год.

Исполнитель ФИО, телефон _____

Приложение № 6

к Правилам осуществления клиринговой деятельности Акционерным
Коммерческим Банком «Национальный Клиринговый Центр» (Закрытое
акционерное общество) при проведении Единой торговой сессии

Временной регламент исполнения обязательств по сделкам, заключенным на Единой торговой сессии¹

№ п/п	Наименование операции	Время (московское)
1.	Обеспечение Участником клиринга наличия на счетах Клирингового центра денежных средств для учета текущим днем в качестве Обеспечения:	
	- в китайских юанях;	до 10:00
	- в казахстанских тенге, белорусских рублях, украинских гривнах;	до 12:00
	- в евро;	до 17:00
	- в долларах США;	до 20:00
	- в российских рублях.	до 20:00
2.	Учет полученных от Участника клиринга денежных средств в качестве Обеспечения	в течение 15 минут с момента получения информации о зачислении денежных средств на счет Клирингового центра в Расчетном банке / Расчетном центре
3.	Передача Участником клиринга в Клиринговый центр Запроса на проведение ранних расчетов.	до 14:00
4.	Определение Итоговых нетто-обязательств / Итоговых нетто-требований по итогам торговой сессии по китайским юаням за российские рубли ²	11:00
5.	Определение Итоговых нетто-обязательств / Итоговых нетто-требований в иностранной валюте / Итоговых обязательств / Итоговых требований в российских рублях:	
	- Участников клиринга, предоставивших Запрос на проведение ранних расчетов до 11:00 или Постоянное поручение на проведение ранних расчетов;	11:00
	- Участников клиринга, предоставивших Запрос на проведение ранних расчетов после 11:00 и до 14:00;	после получения Клиринговым центром Запроса на проведение ранних расчетов
	- Участников клиринга, не предоставивших Запрос на проведение ранних расчетов или Постоянное поручение на проведение ранних расчетов.	15:15

№ п/п	Наименование операции	Время (московское)
6.	Передача Клиринговым центром предварительных Биржевых свидетельств по итогам торговой сессии по китайским юаням за российские рубли ² .	с 11:00 до 11:15
7.	Передача Клиринговым центром Клиринговых отчетов по итогам Торговых сессий ЕТС, Биржевых свидетельств по итогам Торговых сессий ЕТС:	
	- Участникам клиринга, предоставившим Запрос на проведение ранних расчетов до 11:00 или Постоянное поручение на проведение ранних расчетов;	с 11:00 до 11:15
	- Участникам клиринга, предоставившим Запрос на проведение ранних расчетов после 11:00 и до 14:00;	в течение 15 мин. после получения Клиринговым центром Запроса на проведение ранних расчетов
	- Участникам клиринга, не предоставившим Запрос на проведение ранних расчетов или Постоянное поручение на проведение ранних расчетов.	с 15:15 до 15:30
8.	Передача Участником клиринга в Клиринговый центр Запросов о депонировании денежных средств:	
	- в казахстанских тенге, белорусских рублях, украинских гривнах, китайских юанях;	до 11:15
	- в долларах США, российских рублях, евро:	
	Участником клиринга, предоставившим Запрос на проведение ранних расчетов до 11:00 или Постоянное поручение на проведение ранних расчетов;	до 11:15
	Участником клиринга, предоставившим Запрос на проведение ранних расчетов после 11:00 и до 14:00;	до направления Запроса на проведение ранних расчетов
	Участником клиринга, не предоставившим Запрос на проведение ранних расчетов или Постоянное поручение на проведение ранних расчетов.	до 15:30
9.	Проведение клиринговой сессии.	с 9:45 до 10:00
10.	Передача Клиринговым центром Участникам клиринга Отчетов об обязательствах, Отчетов о Маржинальном требовании, Требований о погашении задолженности, Отчетов о движении денежных средств.	до 10:15
11.	Исполнение Маржинальных требований.	до 17:30 дня возникновения Маржинального требования

№ п/п	Наименование операции	Время (московское)
12.	Погашение Задолженностей по компенсационным взносам.	до 20:00 дня возникновения Задолженности по компенсационным взносам
13.	Погашение Задолженностей по комиссиям и Задолженностей по сделкам.	до 20:00 Рабочего дня, следующего за днем возникновения Задолженности по комиссиям / Задолженности по сделкам
14.	Передача Клиринговым центром Отчетов о комиссионных вознаграждениях и Клиринговых отчетов по итогам Торговых сессий ЕТС, содержащих информацию о Сделках с Датой исполнения в дату их заключения, заключенных после 15:15:	
	- Участникам клиринга, предоставившим Запрос или Постоянное поручение на раннее завершение заключения сделок с Клиринговым центром в 17:00;	до 17:15
	- Участникам клиринга, предоставившим Запрос или Постоянное поручение на раннее завершение заключения сделок с Клиринговым центром в 19:00;	до 19:15
	- Участникам клиринга, не предоставившим Запрос или Постоянное поручение на раннее завершение заключения сделок с Клиринговым центром.	до 09:30 следующего Рабочего дня
15.	Исполнение Участниками клиринга Итоговых нетто-обязательств в китайских юанях перед Клиринговым центром ² .	до 12:00
16.	Исполнение Участниками клиринга Итоговых нетто-обязательств / Итоговых обязательств перед Клиринговым центром:	
	- в евро;	до 17:00 ³
	- в долларах США и российских рублях.	до 20:00 ³
17.	Исполнение Участниками клиринга обязательств по уплате комиссионных вознаграждений:	
	- по Сделкам, заключенным до 19:00	до 20:00 ³
	- по Сделкам, заключенным после 19:00	до 20:00 ³ следующего Рабочего дня
18.	Передача Клиринговым центром Участникам клиринга Клиринговых отчетов по итогам Торговых сессий ЕТС и Дополнительной сессии ЕТС, Биржевых свидетельств по итогам Торговых сессий ЕТС и Дополнительной сессии ЕТС.	до 20:15

№ п/п	Наименование операции	Время (московское)
19.	Перечисление Клиринговым центром денежных средств на счета Участников клиринга с целью исполнения Итоговых нетто-требований / Итоговых требований Участников клиринга:	
	- в китайских юанях ⁴ ;	до 12:00
	- в казахстанских тенге, белорусских рублях, украинских гривнах;	до 12:00
	- в китайских юанях ² ;	до 13:00
	- в евро, долларах США, российских рублях.	в день торгов
20.	Передача Участником клиринга в Клиринговый центр Запросов о возврате денежных средств:	
	- в китайских юанях;	до 11:00
	- в казахстанских тенге, белорусских рублях, украинских гривнах;	до 12:00
	- в евро;	до 17:00
	- в долларах США;	до 20:00
	- в российских рублях.	до 20:00
21.	Передача Участником клиринга в Клиринговый центр Заявления о переносе.	до 17:00

¹ - решением Клирингового центра время проведения отдельных операций, за исключением времени проведения Основных сессий ЕТС, может быть изменено.

² – в случае если китайские юани за российские рубли включены в Перечень инструментов, по которым заключаются Сделками с частичным обеспечением;

³ - при наличии сбоя в платежных системах указанное время может быть продлено по решению Клирингового центра до устранения указанного сбоя;

⁴ - в случае если китайские юани за российские рубли включены в Перечень инструментов, по которым заключаются Сделками с полным обеспечением.

Приложение № 7

к Правилам осуществления клиринговой деятельности Акционерным
Коммерческим Банком «Национальный Клиринговый Центр» (Закрытое
акционерное общество) при проведении Единой торговой сессии

БИРЖЕВОЕ СВИДЕТЕЛЬСТВО
по итогам Торговых сессий ЕТС «дата»

Участник клиринга:

<Регистрационный код> <Наименование>

<Расчетный код 1>

Код валюты		Требование	Обязательство
<код валюты>	Итоговое нетто-требование / Итоговое нетто-обязательство	<сумма>	<сумма>
...			
<код валюты>	Итоговое нетто-требование / Итоговое нетто-обязательство	<сумма>	<сумма>
RUB	Итоговое обязательство / Итоговое требование, в т.ч.:	<сумма>	<сумма>
	Итоговое Нетто-требование / Итоговое Нетто-обязательство	<сумма>	<сумма>
	Обязательство по возврату Компенсационных взносов	<сумма>	<сумма>

...

<Расчетный код N>

Код валюты		Требование	Обязательство
<код валюты>	Итоговое нетто-требование / Итоговое нетто-обязательство	<сумма>	<сумма>
...			
<код валюты>	Итоговое нетто-требование / Итоговое нетто-обязательство	<сумма>	<сумма>
RUB	Итоговое обязательство / Итоговое требование, в т.ч.:	<сумма>	<сумма>
	Итоговое Нетто-требование / Итоговое Нетто-обязательство	<сумма>	<сумма>
	Обязательство по возврату Компенсационных взносов	<сумма>	<сумма>

Расчеты осуществляются в сроки, установленные Правилами осуществления клиринговой деятельности Акционерным Коммерческим Банком «Национальный Клиринговый Центр» (Закрытое акционерное общество) при проведении Единой торговой сессии.

Дата:

Подпись уполномоченного лица ЗАО АКБ «Национальный Клиринговый Центр»:
_____/Ф.И.О./

Приложение № 8

к Правилам осуществления клиринговой деятельности Акционерным
Коммерческим Банком «Национальный Клиринговый Центр» (Закрытое
акционерное общество) при проведении Единой торговой сессии

БИРЖЕВОЕ СВИДЕТЕЛЬСТВО
по итогам Торговых сессий ЕТС и Дополнительной сессии ЕТС «дата»

Участник клиринга:

<Регистрационный код> <Наименование>

<Расчетный код 1>

Код валюты		Требование	Обязательство
<код валюты>	Итоговое нетто-требование / Итоговое нетто-обязательство	<сумма>	<сумма>
...			
<код валюты>	Итоговое нетто-требование / Итоговое нетто-обязательство	<сумма>	<сумма>
RUB	Итоговое обязательство / Итоговое требование, в т.ч.:	<сумма>	<сумма>
	Итоговое Нетто-требование / Итоговое Нетто-обязательство	<сумма>	<сумма>
	Обязательство по возврату Компенсационных взносов	<сумма>	<сумма>

...

<Расчетный код N>

Код валюты		Требование	Обязательство
<код валюты>	Итоговое нетто-требование / Итоговое нетто-обязательство	<сумма>	<сумма>
...			
<код валюты>	Итоговое нетто-требование / Итоговое нетто-обязательство	<сумма>	<сумма>
RUB	Итоговое обязательство / Итоговое требование, в т.ч.:	<сумма>	<сумма>
	Итоговое Нетто-требование / Итоговое Нетто-обязательство	<сумма>	<сумма>
	Обязательство по возврату Компенсационных взносов	<сумма>	<сумма>

Расчеты осуществляются в сроки, установленные Правилами осуществления клиринговой деятельности Акционерным Коммерческим Банком «Национальный Клиринговый Центр» (Закрытое акционерное общество) при проведении Единой торговой сессии.

Дата:

Подпись уполномоченного лица ЗАО АКБ «Национальный Клиринговый Центр»:
_____/Ф.И.О./

Приложение № 9

к Правилам осуществления клиринговой деятельности Акционерным
Коммерческим Банком «Национальный Клиринговый Центр» (Закрытое
акционерное общество) при проведении Единой торговой сессии

**ОТЧЕТ О КОМИССИОННЫХ ВОЗНАГРАЖДЕНИЯХ
по итогам Основных сессий ЕТС «дата»**

Участник клиринга:

<Регистрационный код> <Наименование>

<Расчетный код 1>

Вид комиссии	Комиссионное вознаграждение ЗАО АКБ «Национальный Клиринговый Центр» за клиринговое обслуживание, руб.		Комиссионное вознаграждение ОАО Московская Биржа за организацию торгов, руб.		Вознаграждение ОАО Московская Биржа за предоставление ИТС, руб.	
	Сумма	в т.ч. НДС	Сумма	в т.ч.НДС	Сумма	в т.ч. НДС
Оборотная часть по сделкам по покупке и продаже*	<сумма>	<сумма>	<сумма>	<сумма>	<сумма>	<сумма>
Постоянная часть по сделкам по покупке и продаже	<сумма>	<сумма>	<сумма>	<сумма>	<сумма>	<сумма>
Оборотная часть по сделкам своп	<сумма>	<сумма>	<сумма>	<сумма>	<сумма>	<сумма>
Постоянная часть по сделкам своп**	<сумма>	<сумма>	<сумма>	<сумма>	<сумма>	<сумма>
Доплата до Минимальной ежемесячной комиссии	<сумма>	<сумма>	<сумма>	<сумма>	<сумма>	<сумма>
Фиксированная часть					<сумма>	<сумма>
Дополнительный комиссионный сбор					<сумма>	<сумма>
Итого:	<сумма>	<сумма>	<сумма>	<сумма>	<сумма>	<сумма>

Итого, включая НДС: <сумма> руб.

...

<Расчетный код N>

Вид комиссии	Комиссионное вознаграждение ЗАО АКБ «Национальный Клиринговый Центр» за клиринговое обслуживание, руб.		Комиссионное вознаграждение ОАО Московская Биржа за организацию торгов, руб.		Вознаграждение ОАО Московская Биржа за предоставление ИТС, руб.	
	Сумма	в т.ч. НДС	Сумма	в т.ч.НДС	Сумма	в т.ч. НДС

Оборотная часть по сделкам по покупке и продаже*	<сумма>	<сумма>	<сумма>	<сумма>	<сумма>	<сумма>
Оборотная часть по сделкам своп	<сумма>	<сумма>	<сумма>	<сумма>	<сумма>	<сумма>
Дополнительный комиссионный сбор					<сумма>	<сумма>
Итого:	<сумма>	<сумма>	<сумма>	<сумма>	<сумма>	<сумма>

* - включает оборотную часть по сделкам по покупке и продаже иностранной валюты с Датой исполнения не ранее, чем на второй Расчетный день после даты заключения сделки

** - и сделкам по покупке и продаже иностранной валюты с Датой исполнения не ранее, чем на второй Расчетный день после даты заключения сделки

Итого, включая НДС: <сумма> руб.

Исполнение обязательств по уплате комиссионных вознаграждений осуществляется в соответствии с Правилами осуществления клиринговой деятельности Акционерным Коммерческим Банком «Национальный Клиринговый Центр» (Закрытое акционерное общество) при проведении Единой торговой сессии.

Дата:

Подпись уполномоченного лица ЗАО АКБ «Национальный Клиринговый Центр»:
_____/Ф.И.О./

Приложение № 10

к Правилам осуществления клиринговой деятельности Акционерным
Коммерческим Банком «Национальный Клиринговый Центр» (Закрытое
акционерное общество) при проведении Единой торговой сессии

ОТЧЕТ О МАРЖИНАЛЬНОМ ТРЕБОВАНИИ

<дата>

<Наименование участника клиринга>
(полное наименование Участника клиринга)
(далее – Участник клиринга)

регистрационный код Участника клиринга: <Регистрационный код>,
расчетный код Участника клиринга: <Расчетный код>

Сумма Маржинального требования в российских рублях составляет:

<сумма>

Маржинальное требование должно быть исполнено в срок до: 17:30 мск. <Дата>

Исполнение Маржинального требования Участником клиринга осуществляется в соответствии с Правилами осуществления клиринговой деятельности Акционерным Коммерческим Банком «Национальный Клиринговый Центр» (Закрытое акционерное общество) при проведении Единой торговой сессии.

Подпись уполномоченного лица ЗАО АКБ «Национальный Клиринговый Центр»:
_____/ФИО/».

Приложение № 11

к Правилам осуществления клиринговой деятельности Акционерным
Коммерческим Банком «Национальный Клиринговый Центр» (Закрытое
акционерное общество) при проведении Единой торговой сессии

(На бланке организации)

ЗАПРОС О ВОЗВРАТЕ ДЕНЕЖНЫХ СРЕДСТВ

(полное наименование Участника клиринга)

Регистрационный код Участника клиринга: _____,

Расчетный код Участника клиринга: _____.

В соответствии с Правилами осуществления клиринговой деятельности Акционерным
Коммерческим Банком «Национальный Клиринговый Центр» (Закрытое акционерное
общество) при проведении Единой торговой сессии просим перечислить денежные средства в
размере _____ на

(сумма цифрами и прописью с указанием валюты)

счет _____ в _____,

указанный нашей Организацией в Перечне платежных реквизитов, представленных в ЗАО
АКБ «Национальный Клиринговый Центр».

(Должность руководителя)

_____/ Ф.И.О. /

М.П.

« ____ » _____ 20 ____ год.

Исполнитель Ф.И.О., телефон _____

Приложение № 12

к Правилам осуществления клиринговой деятельности Акционерным
Коммерческим Банком «Национальный Клиринговый Центр» (Закрытое
акционерное общество) при проведении Единой торговой сессии

(На бланке организации)

**ПОСТОЯННОЕ ПОРУЧЕНИЕ
на возврат денежных средств**

(полное наименование Участника клиринга)

Регистрационный код Участника клиринга: _____,

Расчетный код Участника клиринга: _____.

В соответствии с Правилами осуществления клиринговой деятельности Акционерным Коммерческим Банком «Национальный Клиринговый Центр» (Закрытое акционерное общество) при проведении Единой торговой сессии просим на постоянной основе осуществлять возврат денежных средств в:

(указать необходимую валюту или необходимые валюты в требуемой последовательности; сначала указываются валюты, средства в которых необходимо вернуть в первую очередь)

путем перечисления на соответствующий(ие) счет(а), указанный(е) нашей Организацией в Перечне платежных реквизитов, представленном в ЗАО АКБ «Национальный Клиринговый Центр».

Настоящее поручение действительно до его письменной отмены.

(Должность руководителя)

_____/ Ф.И.О. /

М.П.

« ____ » _____ 20 ____ год.

Исполнитель Ф.И.О., телефон _____

Приложение № 13

к Правилам осуществления клиринговой деятельности Акционерным
Коммерческим Банком «Национальный Клиринговый Центр» (Закрытое
акционерное общество) при проведении Единой торговой сессии

(На бланке организации)

ЗАПРОС НА ПРОВЕДЕНИЕ РАННИХ РАСЧЕТОВ

(полное наименование Участника клиринга)

Регистрационный код Участника клиринга: _____,

Расчетный код Участника клиринга: _____.

В соответствии с Правилами осуществления клиринговой деятельности Акционерным
Коммерческим Банком «Национальный Клиринговый Центр» (Закрытое акционерное
общество) при проведении Единой торговой сессии просим _____

дата

начать проведение расчетов по заключенным в ходе Торговых сессий ЕТС и
Дополнительных сессий ЕТС Сделкам с частичным обеспечением с наступившей Датой
исполнения сразу после получения настоящего поручения, но не ранее 11:00 по московскому
времени.

(Должность руководителя)

/ Ф.И.О. /

М.П.

« ____ » _____ 20 ____ год.

Исполнитель Ф.И.О., телефон _____

Приложение № 14

к Правилам осуществления клиринговой деятельности Акционерным
Коммерческим Банком «Национальный Клиринговый Центр» (Закрытое
акционерное общество) при проведении Единой торговой сессии

(На бланке организации)

**ПОСТОЯННОЕ ПОРУЧЕНИЕ
на проведение ранних расчетов**

(полное наименование Участника клиринга)

Регистрационный код Участника клиринга: _____,

Расчетный код Участника клиринга: _____.

В соответствии с Правилами осуществления клиринговой деятельности Акционерным Коммерческим Банком «Национальный Клиринговый Центр» (Закрытое акционерное общество) при проведении Единой торговой сессии просим с даты, следующей за датой получения настоящего поручения, начинать проведение расчетов по заключенным в ходе Торговых сессий ЕТС и Дополнительных сессий ЕТС Сделкам с частичным обеспечением с наступившей Датой исполнения с 11:00 по московскому времени.

(Должность руководителя)

_____ / Ф.И.О. /

М.П.

« ____ » _____ 20 ____ год.

Исполнитель Ф.И.О., телефон _____

Приложение № 15

к Правилам осуществления клиринговой деятельности Акционерным
Коммерческим Банком «Национальный Клиринговый Центр» (Закрытое
акционерное общество) при проведении Единой торговой сессии

(На бланке организации)

ЗАПРОС
о депонировании денежных средств

(полное наименование Участника клиринга)

Регистрационный код Участника клиринга: _____,

Расчетный код Участника клиринга: _____.

В соответствии с Правилами осуществления клиринговой деятельности Акционерным Коммерческим Банком «Национальный Клиринговый Центр» (Закрытое акционерное общество) при проведении Единой торговой сессии просим денежные средства, в размере

(сумма цифрами и прописью с указанием валюты)

причитающиеся нашей Организации по итогам клиринга за «день» «месяц» «год», не переводить на корреспондентский счет, указанный нашей Организацией в Перечне платежных реквизитов, представленных в ЗАО АКБ «Национальный Клиринговый Центр», и учесть указанные денежные средства, как средства для участия в торгах.

(Должность руководителя)

/ Ф.И.О. /

М.П.

« ____ » _____ 20 ____ год.

Исполнитель Ф.И.О., телефон _____

Приложение № 16

к Правилам осуществления клиринговой деятельности Акционерным
Коммерческим Банком «Национальный Клиринговый Центр» (Закрытое
акционерное общество) при проведении Единой торговой сессии

ТРЕБОВАНИЕ О ПОГАШЕНИИ ЗАДОЛЖЕННОСТИ

<дата>

<Наименование участника клиринга>
(полное наименование Участника клиринга)
(далее – Участник клиринга)

регистрационный код Участника клиринга: <Регистрационный код>,
расчетный код Участника клиринга: <Расчетный код>

Задолженность по сделкам Участника клиринга перед ЗАО АКБ «Национальный
Клиринговый Центр» составляет:

RUB <сумма>

Задолженность по комиссиям Участника клиринга перед ЗАО АКБ «Национальный
Клиринговый Центр» составляет:

RUB <сумма>

Задолженность по компенсационным взносам Участника клиринга перед ЗАО АКБ
«Национальный Клиринговый Центр» составляет:

RUB <сумма>

Задолженность по сделкам, Задолженность по комиссиям и Задолженность по
компенсационным взносам Участника клиринга перед ЗАО АКБ «Национальный
Клиринговый Центр»

в RUB должна быть погашена в срок до 20:00 мск. <Дата>

Погашение Задолженности по сделкам и/или Задолженности по комиссиям и/или
Задолженность по компенсационным взносам Участника клиринга перед ЗАО АКБ
«Национальный Клиринговый Центр» осуществляется в соответствии с Правилами
осуществления клиринговой деятельности Акционерным Коммерческим Банком
«Национальный Клиринговый Центр» (Закрытое акционерное общество) при проведении
Единой торговой сессии.

Подпись уполномоченного лица ЗАО АКБ «Национальный Клиринговый Центр»:
_____/Ф.И.О./.

Приложение № 17

к Правилам осуществления клиринговой деятельности Акционерным
Коммерческим Банком «Национальный Клиринговый Центр» (Закрытое
акционерное общество) при проведении Единой торговой сессии

**ОСНОВНЫЕ ПОКАЗАТЕЛИ ДЕЯТЕЛЬНОСТИ УЧАСТНИКА КЛИРИНГА – БАНКА-
НЕРЕЗИДЕНТА ЗА _____ Г.**
(отчетный месяц год)

(единицы измерения)

	Показатели	дд. мм. гггг.
1.	Активы всего:	
1.1.	Денежные средства и остатки на корреспондентских счетах в финансовых организациях (в т.ч. центральных банках)	
1.2	Депозиты и другие размещенные средства в финансовых организациях	
1.3.	Вложения в ценные бумаги (кроме векселей),	
1.3.1.	в т.ч. вложения в государственные долговые обязательства	
1.4.	Кредиты и другие размещенные средства в нефинансовых организациях	
	- доля просроченной задолженности (в %)	
	- сформированный резерв (в %)	
1.4.1.	в т.ч. кредиты юридическим лицам	
	- доля просроченной задолженности (в %)	
1.4.2.	в т.ч. кредиты физическим лицам	
	- доля просроченной задолженности (в %)	
1.5	Прочие активы	
2.	Обязательства всего, в т.ч.:	
2.1	Средства на счетах и привлеченные кредиты и депозиты других банков	
2.2.	Средства на счетах юридических лиц (включая депозиты)	
2.3.	Средства на счетах физических лиц (включая депозиты)	
2.4.	Выпущенные долговые обязательства	
2.5.	Доля средств «до востребования» в обязательствах (в %)	
3.	Собственные средства (капитал)	
4.	Прибыль (убыток) (текущего года)	
5.	Рентабельность активов (ROA)	
6.	Рентабельность капитала (ROE)	

(Должность руководителя)

/Ф.И.О./

М.П.

«___» _____ 20__ год.

Исполнитель Ф.И.О., телефон _____

Приложение № 18

к Правилам осуществления клиринговой деятельности Акционерным
Коммерческим Банком «Национальный Клиринговый Центр» (Закрытое
акционерное общество) при проведении Единой торговой сессии

Опросная Анкета Банка – нерезидента

Являются ли банки в Вашей стране субъектами исполнения законодательства о противодействии отмыванию преступных доходов и финансированию терроризма? Если да, то укажите, пожалуйста, действующие законодательные и иные нормативные акты в области противодействия отмыванию преступных доходов и финансированию терроризма, которые обязан соблюдать Ваш Банк.	
Приняты ли в Банке нормативные документы, регламентирующие процедуры осуществления внутреннего контроля, направленного на противодействие отмыванию преступных доходов и финансированию терроризма? Если да, то перечислите, пожалуйста, их.	
Имеются ли у Вашего Банка филиалы и дочерние общества? Если да, то перечислите, пожалуйста. Все ли филиалы и дочерние общества Вашего Банка придерживаются той же политики в области противодействия отмыванию преступных доходов и финансированию терроризма, что и головная организация?	
Назначен ли в Вашем Банке сотрудник, ответственный за организацию работы, направленной на противодействие отмыванию преступных доходов и финансированию терроризма? Укажите его ФИО, должность, телефон, факс, адрес электронной почты	
Применяется ли Вашим Банком процедура «Знай своего клиента»? Если да, то, каким образом?	
Является ли учет и хранение документов и информации составной частью процедуры внутреннего контроля в области противодействия отмыванию преступных доходов и финансированию терроризма?	
Проводится ли проверка потенциальных клиентов на предмет наличия информации о них в списках лиц и организаций, причастных к террористической деятельности?	
Осуществляется ли обучение сотрудников Банка по вопросам противодействия отмыванию преступных доходов и финансированию терроризма?	

(Должность руководителя)

М.П.

_____/Ф.И.О./

« ____ » _____ 20 ____ год.

Исполнитель Ф.И.О., телефон _____

Приложение № 19

к Правилам осуществления клиринговой деятельности Акционерным
Коммерческим Банком «Национальный Клиринговый Центр» (Закрытое
акционерное общество) при проведении Единой торговой сессии

Анкета физического лица

Фамилия, имя и (если иное не вытекает из закона или национального обычая) отчество		
Дата и место рождения		
Гражданство		
Реквизиты документа, удостоверяющего личность	Наименование документа	
	Серия документа	
	Номер документа	
	Дата выдачи	
	Наименование органа, выдавшего документ	
	Код подразделения (если имеется)	
Данные миграционной карты	Номер карты	
	Дата начала срока пребывания	
	Дата окончания срока пребывания	
Данные документа, подтверждающего право иностранного гражданина или лица без гражданства на пребывание (проживание) в Российской Федерации	Наименование документа	
	Серия (если имеется) и номер документа	
	Дата начала срока действия права пребывания (проживания)	
	Дата окончания срока действия права пребывания (проживания)	
Место жительства (регистрации)		
Место пребывания		
Идентификационный номер налогоплательщика (если имеется)		
Номера контактных телефонов и факсов		

(Должность руководителя)

М.П.

_____/Ф.И.О./

« ____ » _____ 20__ год.

Приложение № 20

к Правилам осуществления клиринговой деятельности Акционерным
Коммерческим Банком «Национальный Клиринговый Центр» (Закрытое
акционерное общество) при проведении Единой торговой сессии

(На бланке организации)

**ЗАЯВЛЕНИЕ О РАСПРЕДЕЛЕНИИ ЛИМИТА,
ОБЕСПЕЧЕННОГО СРЕДСТВАМИ ФОНДА**

(полное наименование Участника клиринга)

Основной Регистрационный код Участника клиринга: _____.

В соответствии с Правилами осуществления клиринговой деятельности Акционерным Коммерческим Банком «Национальный Клиринговый Центр» (Закрытое акционерное общество) при проведении Единой торговой сессии просим распределить Лимит, обеспеченный средствами фонда, установленный для нашей Организации в соответствии с Методикой лимитирования операций на валютном рынке, между Регистрационными и Расчетными кодами нашей Организации, как указано ниже:

<Регистрационный код 1>

<Расчетный код 1>: <величина (с учетом знака), на которую должен быть изменен Лимит, обеспеченный средствами фонда, по Расчетному коду> рублей.

...

<Расчетный код N>: <величина (с учетом знака), на которую должен быть изменен Лимит, обеспеченный средствами фонда, по Расчетному коду> рублей.

<Регистрационный код N>

<Расчетный код 1>: <величина (с учетом знака), на которую должен быть изменен Лимит, обеспеченный средствами фонда, по Расчетному коду> рублей.

...

<Расчетный код N>: <величина (с учетом знака), на которую должен быть изменен Лимит, обеспеченный средствами фонда, по Расчетному коду> рублей.

(Должность руководителя)

/ Ф.И.О. /

М.П.

« ____ » _____ 20 ____ год.

Исполнитель Ф.И.О., телефон _____

Приложение № 21

к Правилам осуществления клиринговой деятельности Акционерным
Коммерческим Банком «Национальный Клиринговый Центр» (Закрытое
акционерное общество) при проведении Единой торговой сессии

(На бланке организации)

ЗАПРОС ОБ УСТАНОВЛЕНИИ ТОРГОВОГО ЛИМИТА

(полное наименование Участника клиринга)

Регистрационный код Участника клиринга: _____,

Расчетный код Участника клиринга: _____.

В соответствии с Правилами осуществления клиринговой деятельности Акционерным
Коммерческим Банком «Национальный Клиринговый Центр» (Закрытое акционерное
общество) при проведении Единой торговой сессии просим установить Торговый лимит в
размере:

_____ рублей.
(сумма цифрами и прописью).

(Должность руководителя)

_____ / Ф.И.О. /

М.П.

« ____ » _____ 20 ____ год.

Исполнитель Ф.И.О., телефон _____

Приложение № 22

к Правилам осуществления клиринговой деятельности Акционерным
Коммерческим Банком «Национальный Клиринговый Центр» (Закрытое
акционерное общество) при проведении Единой торговой сессии

(На бланке организации)

**ПОСТОЯННОЕ ПОРУЧЕНИЕ
на депонирование денежных средств**

(полное наименование Участника клиринга)

Регистрационный код Участника клиринга: _____,

Расчетный код Участника клиринга: _____.

В соответствии с Правилами осуществления клиринговой деятельности Акционерным Коммерческим Банком «Национальный Клиринговый Центр» (Закрытое акционерное общество) при проведении Единой торговой сессии просим на постоянной основе денежные средства в:

(указать перечень необходимых валют)

причитающиеся нашей Организации по итогам клиринга, не переводить на корреспондентский счет, указанный нашей Организацией в Перечне платежных реквизитов, представленных в ЗАО АКБ «Национальный Клиринговый Центр», и учесть указанные денежные средства, как средства для участия в торгах.

Настоящее поручение действительно до его письменной отмены.

(Должность руководителя)

_____/ Ф.И.О. /

М.П.

« ____ » _____ 20 ____ год.

Исполнитель Ф.И.О., телефон _____

Приложение № 23

к Правилам осуществления клиринговой деятельности Акционерным
Коммерческим Банком «Национальный Клиринговый Центр» (Закрытое
акционерное общество) при проведении Единой торговой сессии

(На бланке организации)

**ЗАПРОС
на раннее завершение заключения сделок с Клиринговым центром**

(полное наименование Участника клиринга)

Регистрационный код Участника клиринга: _____,

Расчетный код Участника клиринга: _____.

В соответствии с Правилами осуществления клиринговой деятельности Акционерным
Коммерческим Банком «Национальный Клиринговый Центр» (Закрытое акционерное
общество) при проведении Единой торговой сессии просим _____
_____ *дата*

завершить заключение сделок по покупке и продаже иностранной валюты с
Клиринговым центром в 17:00 / 19:00 по московскому времени.
(указать время)

(Должность руководителя)

_____/ Ф.И.О. /

М.П.

«____» _____ 20__ год.

Исполнитель Ф.И.О., телефон _____

Приложение № 24

к Правилам осуществления клиринговой деятельности Акционерным
Коммерческим Банком «Национальный Клиринговый Центр» (Закрытое
акционерное общество) при проведении Единой торговой сессии

(На бланке организации)

**ПОСТОЯННОЕ ПОРУЧЕНИЕ
на раннее завершение заключения сделок с Клиринговым центром**

(полное наименование Участника клиринга)

Регистрационный код Участника клиринга: _____,

Расчетный код Участника клиринга: _____.

В соответствии с Правилами осуществления клиринговой деятельности Акционерным Коммерческим Банком «Национальный Клиринговый Центр» (Закрытое акционерное общество) при проведении Единой торговой сессии просим с даты, следующей за датой получения настоящего поручения, завершать заключение сделок по покупке и продаже иностранной валюты с Клиринговым центром, в 17:00 / 19:00 по московскому времени.

(указать время)

(Должность руководителя)

_____/ Ф.И.О. /

М.П.

« ____ » _____ 20 ____ год.

Исполнитель Ф.И.О., телефон _____

Приложение № 25

к Правилам осуществления клиринговой деятельности Акционерным
Коммерческим Банком «Национальный Клиринговый Центр» (Закрытое
акционерное общество) при проведении Единой торговой сессии

КЛИРИНГОВЫЙ ОТЧЕТ
по итогам Торговых сессий ЕТС

Клиринговый центр: ЗАО АКБ «Национальный Клиринговый Центр»

Дата исполнения сделок: <Дата>

Время формирования отчета <Время>

<Регистрационный код> <Наименование>

<Расчетный код 1>

Валюта лота			<Код валюты>						
Сопряж. валюта			<Код валюты>						
Номер сделки	Дата заключения сделки	Время заключения сделки	Инструмент	Тип сделки	Направление сделки	Объем в валюте лота (в единицах валюты)	Объем в сопряж. валюте	Курс	Код клиента
				К/П	<S>/				
				Своп	<S>/				
				БКТ	<S>/				
Итого покупка						<сумма>	<сумма>		
Итого продажа						<сумма>	<сумма>		

Валюта лота		<Код валюты>
Сопряж. валюта		<Код валюты>

Номер сделки	Дата заключения сделки	Время заключения сделки	Инструмент	Тип сделки	Направление сделки	Объем в валюте лота (в единицах валюты)	Объем в сопряж. валюте	Курс	Код клиента
				К/П	<S>/				
				Своп	<S>/				
				БКТ	<S>/				
<i>Итого покупка</i>						<сумма>	<сумма>		
<i>Итого продажа</i>						<сумма>	<сумма>		

...

«Расчетный код N»

Валюта лота			<Код валюты>						
Сопряж. валюта			<Код валюты>						
Номер сделки	Дата заключения сделки	Время заключения сделки	Инструмент	Тип сделки	Направление сделки	Объем в валюте лота (в единицах валюты)	Объем в сопряж. валюте	Курс	Код клиента
				К/П	<S>/				
				Своп	<S>/				
				БКТ	<S>/				
<i>Итого покупка</i>						<сумма>	<сумма>		
<i>Итого продажа</i>						<сумма>	<сумма>		

Валюта лота			<Код валюты>						
Сопряж. валюта			<Код валюты>						

Номер сделки	Дата заключения сделки	Время заключения сделки	Инструмент	Тип сделки	Направление сделки	Объем в валюте лота (в единицах валюты)	Объем в сопряж. валюте	Курс	Код клиента
				К/П	<S>/				
				Своп	<S>/				
				БКТ	<S>/				
<i>Итого покупка</i>						<сумма>	<сумма>		
<i>Итого продажа</i>						<сумма>	<сумма>		

Дата:

Подпись уполномоченного лица ЗАО АКБ «Национальный Клиринговый Центр»: _____/Ф.И.О./

Приложение № 26

к Правилам осуществления клиринговой деятельности Акционерным
Коммерческим Банком «Национальный Клиринговый Центр» (Закрытое
акционерное общество) при проведении Единой торговой сессии

КЛИРИНГОВЫЙ ОТЧЕТ
по итогам Торговых сессий ЕТС и Дополнительной сессии ЕТС

Клиринговый центр: ЗАО АКБ «Национальный Клиринговый Центр»

Дата исполнения сделок <Дата>

Время формирования отчета <Время>

<Регистрационный код> <Наименование>

<Расчетный код 1>

Валюта лота			<Код валюты>						
Сопряж. валюта			<Код валюты>						
Номер сделки	Дата заключения сделки	Время заключения сделки	Инструмент	Тип сделки	Направление сделки	Объем в валюте лота (в единицах валюты)	Объем в сопряж. валюте	Курс	Код клиента
				К/П	<S>/				
				Своп	<S>/				
				БКТ	<S>/				
Итого покупка						<сумма>	<сумма>		
Итого продажа						<сумма>	<сумма>		

Валюта лота	<Код валюты>
Сопряж. валюта	<Код валюты>

Номер сделки	Дата заключения сделки	Время заключения сделки	Инструмент	Тип сделки	Направление сделки	Объем в валюте лота (в единицах валюты)	Объем в сопряж. валюте	Курс	Код клиента
				К/П	<S>/				
				Своп	<S>/				
				БКТ	<S>/				
Итого покупка						<сумма>	<сумма>		
Итого продажа						<сумма>	<сумма>		

...

«Расчетный код N»

Валюта лота			<Код валюты>						
Сопряж. валюта			<Код валюты>						
Номер сделки	Дата заключения сделки	Время заключения сделки	Инструмент	Тип сделки	Направление сделки	Объем в валюте лота (в единицах валюты)	Объем в сопряж. валюте	Курс	Код клиента
				К/П	<S>/				
				Своп	<S>/				
				БКТ	<S>/				
Итого покупка						<сумма>	<сумма>		
Итого продажа						<сумма>	<сумма>		

Валюта лота			<Код валюты>						
Сопряж. валюта			<Код валюты>						
Номер сделки	Дата заключения сделки	Время заключения сделки	Инструмент	Тип сделки	Направление сделки	Объем в валюте лота (в единицах валюты)	Объем в сопряж. валюте	Курс	Код клиента

				К/П	<S>/				
				Своп	<S>/				
				БКТ	<S>/				
<i>Итого покупка</i>						<сумма>	<сумма>		
<i>Итого продажа</i>						<сумма>	<сумма>		

Дата:

Подпись уполномоченного лица ЗАО АКБ «Национальный Клиринговый Центр»: _____/Ф.И.О./

Приложение № 27

к Правилам осуществления клиринговой деятельности Акционерным
Коммерческим Банком «Национальный Клиринговый Центр» (Закрытое
акционерное общество) при проведении Единой торговой сессии

ОТЧЕТ ОБ ОБЯЗАТЕЛЬСТВАХ

Клиринговый центр: ЗАО АКБ «Национальный Клиринговый Центр»

Участник клиринга:

<Регистрационный код> <Наименование>

<Расчетный код 1>

Дата исполнения	Код валюты	Код валюты лота / код сопряженной валюты	Наименование обязательства	Размер обязательства / Нетто-обязательства	Размер требования / Нетто-требования
<дата 1>*	RUB	-	Обязательство по уплате Компенсационного взноса	<размер>	<размер>
<дата 2>	<код валюты>	-	Нетто-требование / Нетто-обязательство	<размер>	<размер>
<дата 2>	<код валюты>	<Код валюты лота / код сопряженной валюты>	Суммарные обязательства / требования по сделкам	<размер>	<размер>
<дата 2>	<код валюты>	<Код валюты лота / код сопряженной валюты>	Суммарные обязательства / требования по сделкам	<размер>	<размер>
<дата 2>	RUB	-	Обязательство по возврату Компенсационных взносов	<размер>	<размер>
...	...		...	...	
<дата n>	<код валюты>	-	Нетто-требование / Нетто-обязательство	<размер>	<размер>
<дата n>	<код валюты>	<Код валюты лота / код сопряженной валюты>	Суммарные обязательства / требования по сделкам	<размер>	<размер>
<дата n>	<код валюты>	<Код валюты лота / код сопряженной валюты>	Суммарные обязательства / требования по сделкам	<размер>	<размер>
<дата n>	RUB	-	Обязательство по возврату Компенсационных взносов	<размер>	<размер>

* - текущая дата

...

<Расчетный код N>

Дата исполнения	Код валюты	Код валюты лота / код сопряженной валюты	Наименование обязательства	Размер обязательства / Нетто-обязательства	Размер требования / Нетто-требования
<дата 1>*	RUB	-	Обязательство по уплате Компенсационного взноса	<размер>	<размер>
<дата 2>	<код валюты>	-	Нетто-требование / Нетто-обязательство	<размер>	<размер>
<дата 2>	<код валюты>	<Код валюты лота / код сопряженной валюты>	Суммарные обязательства / требования по сделкам	<размер>	<размер>
<дата 2>	<код валюты>	<Код валюты лота / код сопряженной валюты>	Суммарные обязательства / требования по сделкам	<размер>	<размер>
<дата 2>	RUB	-	Обязательство по возврату Компенсационных взносов	<размер>	<размер>
...	...		...	...	
<дата n>	<код валюты>	-	Нетто-требование / Нетто-обязательство	<размер>	<размер>
<дата n>	<код валюты>	<Код валюты лота / код сопряженной валюты>	Суммарные обязательства / требования по сделкам	<размер>	<размер>
<дата n>	<код валюты>	<Код валюты лота / код сопряженной валюты>	Суммарные обязательства / требования по сделкам	<размер>	<размер>
<дата n>	RUB	-	Обязательство по возврату Компенсационных взносов	<размер>	<размер>

* - текущая дата

Дата:

Подпись уполномоченного лица ЗАО АКБ «Национальный Клиринговый Центр»:
 _____/Ф.И.О./

Приложение № 28

к Правилам осуществления клиринговой деятельности Акционерным
Коммерческим Банком «Национальный Клиринговый Центр» (Закрытое
акционерное общество) при проведении Единой торговой сессии

Пункт 1.1. Образец Договора об оказании клиринговых услуг, заключаемого с организациями, не являющимися Участниками клиринга.

Договор об оказании клиринговых услуг № _____

город Москва

«__» _____ 20__ года

Участник клиринга (полное фирменное наименование)	
Клиринговая организация	Акционерный Коммерческий Банк «Национальный Клиринговый Центр» (Закрытое акционерное общество)

1. Клиринговая организация обязуется в соответствии с правилами клиринга оказывать участнику клиринга клиринговые и иные связанные с клирингом услуги, а участник клиринга обязуется оплачивать указанные услуги.
2. Состав услуг, условия и порядок их оказания, размер и порядок оплаты, а также иные права и обязанности сторон, связанные с клиринговым обслуживанием, устанавливаются правилами клиринга клиринговой организации. Клиринговая организация вправе утверждать различные правила клиринга, регламентирующие различные направления клиринговой деятельности.

	От имени участника клиринга	От имени клиринговой организации
ФИО		
Должность		
Основание полномочий		
Подпись, печать		

Пункт 1.2. Образец Договора об оказании клиринговых услуг, заключаемого с организациями, являющимися Участниками клиринга на основании Договора на клиринговое обслуживание с правом участия в Фонде или Договора на клиринговое обслуживание без права участия в Фонде.

Договор об оказании клиринговых услуг № _____

город Москва

«__» _____ 20__ года

Участник клиринга (полное фирменное наименование)	
Клиринговая организация	Акционерный Коммерческий Банк «Национальный Клиринговый Центр» (Закрытое акционерное общество)

1. Клиринговая организация обязуется в соответствии с правилами клиринга оказывать участнику клиринга клиринговые и иные связанные с клирингом услуги, а участник клиринга обязуется оплачивать указанные услуги.
2. Состав услуг, условия и порядок их оказания, размер и порядок оплаты, а также иные права и обязанности сторон, связанные с клиринговым обслуживанием, устанавливаются правилами клиринга клиринговой организации. Клиринговая организация вправе утверждать различные правила клиринга, регламентирующие различные направления клиринговой деятельности.
3. С даты начала оказания клиринговых услуг в соответствии с настоящим договором прекращается действие всех иных договоров, регламентирующих оказание клиринговых услуг, ранее заключенных между клиринговой организацией и участником клиринга.

	От имени участника клиринга	От имени клиринговой организации
ФИО		
Должность		
Основание полномочий		
Подпись, печать		

Приложение № 29

к Правилам осуществления клиринговой деятельности Акционерным
Коммерческим Банком «Национальный Клиринговый Центр» (Закрытое
акционерное общество) при проведении Единой торговой сессии

(На бланке организации)

ЗАЯВЛЕНИЕ О ПРИСВОЕНИИ ДОПОЛНИТЕЛЬНОГО РАСЧЕТНОГО КОДА

(полное наименование Участника клиринга)

Регистрационный код Участника клиринга: _____,

Основной Расчетный код Участника клиринга: _____.

В соответствии с Правилами осуществления клиринговой деятельности Акционерным Коммерческим Банком «Национальный Клиринговый Центр» (Закрытое акционерное общество) при проведении Единой торговой сессии просим присвоить нашей Организации дополнительный Расчетный код.

**ПЕРЕЧЕНЬ ПЛАТЕЖНЫХ РЕКВИЗИТОВ
в иностранной валюте и российских рублях
для проведения расчетов через**

(наименование Расчетного центра)

Наименование банка - корреспондента	Реквизиты корреспондентского счета
В российских рублях:	
Наименование Банка получателя*	Наименование получателя БИК ИНН/КПП К/с Л/с
В иностранной валюте:	
Наименование Банка корреспондента Свифт – код Номер счета Банка корреспондента в Банке посреднике (если есть необходимость) Наименование Банка посредника Свифт – код	Наименование получателя на английском языке Свифт – код и/или номер счета
Свифт – код (заполняется в случае, если организация хочет получать отчеты по Свифт)	

(Должность руководителя)

_____ / Ф.И.О. /

М.П.

« ____ » _____ 20 ____ год.

Исполнитель Ф.И.О., телефон _____

* В случае если получателем услуг по Договору об оказании клиринговых услуг является филиал кредитной организации (Государственной корпорации) или получателем средств является филиал кредитной организации (Государственной корпорации), в обязательном порядке необходимо указание полного наименования данного филиала.

Приложение № 30

к Правилам осуществления клиринговой деятельности Акционерным
Коммерческим Банком «Национальный Клиринговый Центр» (Закрытое
акционерное общество) при проведении Единой торговой сессии

(На бланке организации)

*В ОАО Московская Биржа
В ЗАО АКБ «Национальный Клиринговый Центр»*

ЗАЯВЛЕНИЕ О ВЫБОРЕ (СМЕНЕ) ТАРИФНОГО ПЛАНА ПО СДЕЛКАМ СВОП

(полное наименование Участника клиринга)

Регистрационный код Участника клиринга: _____,

В соответствии с Правилами осуществления клиринговой деятельности Акционерным
Коммерческим Банком «Национальный Клиринговый Центр» (Закрытое акционерное
общество) при проведении Единой торговой сессии просим с _____
(месяц, год)

установить для нашей Организации тарифный план _____
(1 (базовый) / 2 (экономный) / 3 (market leader))

для сделок своп и сделок по покупке и продаже иностранной валюты с Датой исполнения не
ранее, чем на второй Расчетный день после даты заключения сделки.

(Должность руководителя)

_____ / Ф.И.О. /

М.П.

« ____ » _____ 20 ____ год.

Исполнитель Ф.И.О., телефон _____

Приложение № 31

к Правилам осуществления клиринговой деятельности Акционерным
Коммерческим Банком «Национальный Клиринговый Центр» (Закрытое
акционерное общество) при проведении Единой торговой сессии

(На бланке организации)

ЗАЯВЛЕНИЕ О ПЕРЕВОДЕ ДЕНЕЖНЫХ СРЕДСТВ

(полное наименование Участника клиринга)

В соответствии с Правилами осуществления клиринговой деятельности Акционерным Коммерческим Банком «Национальный Клиринговый Центр» (Закрытое акционерное общество) при проведении Единой торговой сессии просим перевести денежные средства нашей Организации, учитываемые в качестве Обеспечения, между Расчетными кодами нашей Организации, как указано ниже:

Расчетный код, по которому учитываются денежные средства, подлежащие списанию	Расчетный код, по которому учитываются денежные средства, подлежащие зачислению	Код валюты	Сумма

(Должность руководителя)

/ Ф.И.О. /

М.П.

« ____ » _____ 20 ____ год.

Исполнитель Ф.И.О., телефон _____

Приложение № 32
к Правилам осуществления клиринговой деятельности Акционерным
Коммерческим Банком «Национальный Клиринговый Центр» (Закрытое
акционерное общество) при проведении Единой торговой сессии

(На бланке организации)

В ЗАО АКБ «Национальный Клиринговый Центр»

Настоящим _____
(полное наименование Участника клиринга)

подтверждает, что им проведена полная процедура идентификации в соответствии с Федеральным законом №115-ФЗ от 07.08.2001 г. «О противодействии легализации (отмыванию) доходов, полученных преступным путем, и финансированию терроризма», своего Клиента

_____,
(полное наименование Клиента Участника клиринга)

а также подтверждает, что по этому Клиенту имеет в наличии документы, подтверждающие сведения, полученные при идентификации.

Участник клиринга обязуется представить ЗАО АКБ «Национальный Клиринговый Центр» по его требованию сведения, полученные при проведении идентификации указанного Клиента.

(Должность руководителя)

М.П.

_____/Ф.И.О./

« ____ » _____ 20 ____ год.

Исполнитель Ф.И.О., телефон _____

Приложение № 33

к Правилам осуществления клиринговой деятельности Акционерным
Коммерческим Банком «Национальный Клиринговый Центр» (Закрытое
акционерное общество) при проведении Единой торговой сессии

(На бланке организации)

В ОАО Московская Биржа
В ЗАО АКБ «Национальный Клиринговый Центр»

**ЗАЯВЛЕНИЕ О ВЫБОРЕ (СМЕНЕ) ТАРИФНОГО ПЛАНА ПО СДЕЛКАМ ПО
ПОКУПКЕ И ПРОДАЖЕ ИНОСТРАННОЙ ВАЛЮТЫ**

(полное наименование Участника клиринга)

Регистрационный код Участника клиринга: _____,

В соответствии с Правилами осуществления клиринговой деятельности Акционерным
Коммерческим Банком «Национальный Клиринговый Центр» (Закрытое акционерное
общество) при проведении Единой торговой сессии просим с _____
(месяц, год)

установить для нашей Организации тарифный план _____
(«Базовый» / «Advanced» / «Maximum»)

для сделок по покупке и продаже иностранной валюты с Датой исполнения в дату заключения
сделки или в первый Расчетный день, следующий за датой заключения сделки.

(Должность руководителя)

_____/ Ф.И.О. /

М.П.

«___» _____ 20__ год.

Исполнитель Ф.И.О., телефон _____

Приложение № 34

к Правилам осуществления клиринговой деятельности Акционерным
Коммерческим Банком «Национальный Клиринговый Центр» (Закрытое
акционерное общество) при проведении Единой торговой сессии

ПОРЯДОК ПРОВЕДЕНИЯ ТЕХНИЧЕСКОЙ ЭКСПЕРТИЗЫ

- 1) Проведение технической экспертизы в случае возникновения конфликтной ситуации в связи с использованием АСП осуществляется технической комиссией, формируемой в случае невозможности разрешения конфликтной ситуации в рабочем порядке.
- 2) Если стороны в конфликтной ситуации не договорятся об ином, в состав технической комиссии входит равное количество, но не менее чем по одному уполномоченному представителю каждой из конфликтующих сторон и Технического центра. Право представлять в технической комиссии соответствующую сторону должно подтверждаться доверенностью, выданной каждому представителю на срок работы технической комиссии.
- 3) Проведение технической экспертизы при разрешении конфликтных ситуаций в соответствии с особенностями функционирования Клиринговой системы требует применения специального программного и информационного обеспечения для выполнения необходимых проверок и документирования данных, используемых при выполнении необходимых проверок.
- 4) Для проведения технической экспертизы необходимы:
 - информация от заявителя претензии (Участника клиринга или Клирингового центра) о параметрах электронного сообщения, в отношении которого проводится техническая экспертиза;
 - дата и время формирования электронного сообщения;
 - номер электронного сообщения, зарегистрированный в Клиринговой системе;
 - параметры электронного сообщения, необходимые для рассмотрения претензии;
 - архив регистрации транзакций в Клиринговой системе на указанную дату (файл TransLog);
 - файлы с электронными сообщениями на указанную дату;
 - рабочее место, позволяющее просматривать и распечатывать информацию из файла TransLog и файлов с электронными сообщениями в удобном для восприятия членами технической комиссии виде;
 - отчетные документы, подтверждающие направление в установленном порядке уведомления о присвоении Клирингового идентификатора уполномоченному представителю заявителю претензии.
- 5) Проведение технической экспертизы включает в себя выполнение следующих действий:
 - изготовление (распечатку) на бумажном носителе копии электронного сообщения, в отношении которого проводится техническая экспертиза;
 - проверку наличия в изготовленной (распечатанной) на бумажном носителе копии электронного сообщения информации о регистрации электронного сообщения, в отношении которого проводится техническая экспертиза;

- проверку соответствия АСП в копии электронного сообщения на бумажном носителе присвоенному Участнику клиринга / Клиринговому центру Клиринговому идентификатору;
- фиксирование результатов проверки в протоколе работы технической комиссии.

6) В случае, если:

- электронное сообщение, в отношении которого проводится техническая экспертиза, найдено в файле TransLog;
- электронное сообщение, в отношении которого проводится техническая экспертиза, соответствует копии электронного сообщения, изготовленной (распечатанной) на бумажном носителе;
- установлено соответствие АСП в копии электронного сообщения на бумажном носителе присвоенному Участнику клиринга / Клиринговому центру Клиринговому идентификатору;

считается установленным, что:

- электронное сообщение, в отношении которого возникла конфликтная ситуация, было сформировано Участником клиринга / Клиринговым центром;
- после подачи электронного сообщения Участником клиринга / Клиринговым центром с использованием Клиринговой системы не было изменено ни одного параметра данного электронного сообщения.

7) Все действия, предпринимаемые технической комиссией для выяснения фактических обстоятельств, а также выводы, сделанные комиссией, заносятся в Протокол работы технической комиссии. Протокол работы технической комиссии должен содержать следующие данные:

- состав технической комиссии с указанием сведений о должности и месте работы каждого из членов технической комиссии;
- краткое изложение обстоятельств возникшей конфликтной ситуации;
- мероприятия, проводимые технической комиссией для установления причин и последствий возникшей конфликтной ситуации, с указанием даты, времени и места их проведения;
- выводы, к которым пришла техническая комиссия в результате проведенных мероприятий;
- подписи всех членов технической комиссии.

Протокол составляется на бумажном носителе в количестве экземпляров, равном количеству организаций, уполномоченные представители которых принимали участие в работе технической комиссии.

Приложение № 35

к Правилам осуществления клиринговой деятельности Акционерным
Коммерческим Банком «Национальный Клиринговый Центр» (Закрытое
акционерное общество) при проведении Единой торговой сессии

ОТЧЕТ О КЛИРИНГОВЫХ ИДЕНТИФИКАТОРАХ
«Дата»

(полное наименование Участника клиринга)

Регистрационный код Участника клиринга: _____,

№	Клиринговый идентификатор	Состояние

Дата:

Подпись уполномоченного лица ЗАО АКБ «Национальный Клиринговый Центр»:
_____/Ф.И.О./

Приложение № 36

к Правилам осуществления клиринговой деятельности Акционерным
Коммерческим Банком «Национальный Клиринговый Центр» (Закрытое
акционерное общество) при проведении Единой торговой сессии

ЗАЯВЛЕНИЕ

о возврате вклада в Фонд покрытия рисков

Регистрационный код Участника клиринга _____

Просим вернуть вклад в Фонд покрытия рисков по следующим реквизитам:

(Должность руководителя)

_____ / Ф.И.О. /

М.П.

«____» _____ 20__ год.

Исполнитель Ф.И.О., телефон _____

Приложение № 37

к Правилам осуществления клиринговой деятельности Акционерным
Коммерческим Банком «Национальный Клиринговый Центр» (Закрытое
акционерное общество) при проведении Единой торговой сессии

(На бланке организации)

ЗАЯВЛЕНИЕ О ПЕРЕНОСЕ

(полное наименование Участника клиринга)

Регистрационный код Участника клиринга: _____

В соответствии с Правилами осуществления клиринговой деятельности Акционерным
Коммерческим Банком «Национальный Клиринговый Центр» (Закрытое акционерное
общество) при проведении Единой торговой сессии (далее – Правила клиринга) просим
изменить Дату исполнения обязательств по Сделкам с частичным обеспечением, учитываемых
по Расчетному коду _____, заключенным за счет Клиента _____,

Код клиента(*)

с _____._____.____ на следующий Расчетный день, а также сообщаем о своем согласии с уплатой
(дата)

комиссионного вознаграждения за исполнение настоящего заявления в сумме и порядке,
установленными Правилами клиринга.

(Должность руководителя)

_____/ Ф.И.О. /

М.П.

« ____ » _____ 20 ____ год.

Исполнитель Ф.И.О., телефон _____

* - Код клиента указывается опционально

Приложение № 38

к Правилам осуществления клиринговой деятельности Акционерным
Коммерческим Банком «Национальный Клиринговый Центр» (Закрытое
акционерное общество) при проведении Единой торговой сессии

ОТЧЕТ О ДВИЖЕНИИ ДЕНЕЖНЫХ СРЕДСТВ
на <Дата>

<Наименование участника клиринга>

<Расчетный код 1>
<Номер счета 1>
(<Наименование счета>)

Код операции	Номер документа	Счет	Комментарии	Дебет	Кредит	Дата
			Входящий остаток	<сумма>	<сумма>	<дата>
<код операции>	<номер документа>	<номер счета>	<назначение платежа 1>	<сумма>	<сумма>	<дата>
<код операции>	<номер документа>	<номер счета >	<назначение платежа N>	<сумма>	<сумма>	<дата>
			Итого:	<сумма>	<сумма>	<дата>
			Исходящий остаток	<сумма>	<сумма>	<дата>

...
<Номер счета N>

...
<Расчетный код N>
<Номер счета 1>
(<Наименование счета>)

Код операции	Номер документа	Счет	Комментарии	Дебет	Кредит	Дата
			Входящий остаток	<сумма>	<сумма>	<дата>
<код операции>	<номер документа>	<номер счета>	<назначение платежа 1>	<сумма>	<сумма>	<дата>

Код операции	Номер документа	Счет	Комментарии	Дебет	Кредит	Дата
			Входящий остаток	<сумма>	<сумма>	<дата>
<код операции>	<номер документа>	<номер счета >	<назначение платежа N>	<сумма>	<сумма>	<дата>
			Итого:	<сумма>	<сумма>	<дата>
			Исходящий остаток	<сумма>	<сумма>	<дата>

...
<Номер счета N>

Дата:

Подпись уполномоченного лица ЗАО АКБ «Национальный Клиринговый Центр»: _____/Ф.И.О./

Приложение № 39

к Правилам осуществления клиринговой деятельности Акционерным
Коммерческим Банком «Национальный Клиринговый Центр» (Закрытое
акционерное общество) при проведении Единой торговой сессии

ПРЕДВАРИТЕЛЬНОЕ БИРЖЕВОЕ СВИДЕТЕЛЬСТВО
по итогам торговой сессии <наименование валюты> за российские рубли «дата»

Участник клиринга:

<Регистрационный код> <Наименование>

<Расчетный код 1>

Код валюты		Требование	Обязательство
<код валюты>	Итоговое нетто-требование / Итоговое нетто-обязательство	<сумма>	<сумма>

...

<Расчетный код N>

Код валюты		Требование	Обязательство
<код валюты>	Итоговое нетто-требование / Итоговое нетто-обязательство	<сумма>	<сумма>

Расчеты осуществляются в сроки, установленные Правилами осуществления клиринговой деятельности Акционерным Коммерческим Банком «Национальный Клиринговый Центр» (Закрытое акционерное общество) при проведении Единой торговой сессии.

Дата:

Подпись уполномоченного лица ЗАО АКБ «Национальный Клиринговый Центр»:
_____/Ф.И.О./

Приложение № 40

к Правилам осуществления клиринговой деятельности Акционерным
Коммерческим Банком «Национальный Клиринговый Центр» (Закрытое
акционерное общество) при проведении Единой торговой сессии

(На бланке организации)

В ЗАО АКБ «Национальный Клиринговый Центр»

**ЗАЯВЛЕНИЕ О ВЫБОРЕ РАСЧЕТНОГО КОДА ДЛЯ СПИСАНИЯ
КОМИССИОННЫХ ВОЗНАГРАЖДЕНИЙ**

(полное наименование Участника клиринга)

Регистрационный код Участника клиринга: _____,

В соответствии с Правилами осуществления клиринговой деятельности Акционерным
Коммерческим Банком «Национальный Клиринговый Центр» (Закрытое акционерное
общество) при проведении Единой торговой сессии просим удерживать постоянные части
комиссионных вознаграждений, Минимальное ежемесячное комиссионное вознаграждение,
Дополнительный комиссионный сбор и фиксированную часть вознаграждения за
предоставление ИТС с Расчетного кода _____.

(Должность руководителя)

_____ / Ф.И.О. /

М.П.

« ____ » _____ 20 ____ год.

Исполнитель Ф.И.О., телефон _____

Приложение № 41

к Правилам осуществления клиринговой деятельности Акционерным
Коммерческим Банком «Национальный Клиринговый Центр» (Закрытое
акционерное общество) при проведении Единой торговой сессии

Отчет о сделках, Дата исполнения которых перенесена

Клиринговый центр: ЗАО АКБ «Национальный Клиринговый Центр»
<Регистрационный код> <Наименование>

Дата исполнения сделок <Дата1>

<Расчетный код 1>

Валюта лота			<Код валюты>						
Сопряж. валюта			<Код валюты>						
Номер сделки	Дата заключения сделки	Время заключения сделки	Инструмент	Тип сделки	Направление сделки	Объем в валюте лота (в единицах валюты)	Объем в сопряж. валюте	Курс	Код клиента
				К/П	<S>/				
				Своп	<S>/				
				БКТ	<S>/				
Итого покупка						<сумма>	<сумма>		
Итого продажа						<сумма>	<сумма>		

Валюта лота		<Код валюты>
Сопряж. Валюта		<Код валюты>

Номер сделки	Дата заключения сделки	Время заключения сделки	Инструмент	Тип сделки	Направление сделки	Объем в валюте лота (в единицах валюты)	Объем в сопряж. валюте	Курс	Код клиента
				К/П	<S>/				
				Своп	<S>/				
				БКТ	<S>/				
Итого покупка						<сумма>	<сумма>		
Итого продажа						<сумма>	<сумма>		

...

«Расчетный код N»

Валюта лота			<Код валюты>						
Сопряж. Валюта			<Код валюты>						
Номер сделки	Дата заключения сделки	Время заключения сделки	Инструмент	Тип сделки	Направление сделки	Объем в валюте лота (в единицах валюты)	Объем в сопряж. валюте	Курс	Код клиента
				К/П	<S>/				
				Своп	<S>/				
				БКТ	<S>/				
Итого покупка						<сумма>	<сумма>		
Итого продажа						<сумма>	<сумма>		

Валюта лота			<Код валюты>						
Сопряж. Валюта			<Код валюты>						
Номер сделки	Дата заключения сделки	Время заключения сделки	Инструмент	Тип сделки	Направление сделки	Объем в валюте лота (в единицах валюты)	Объем в сопряж. валюте	Курс	Код клиента

				К/П	<S>/				
				Своп	<S>/				
				БКТ	<S>/				
Итого покупка						<сумма>	<сумма>		
Итого продажа						<сумма>	<сумма>		

Дата исполнения сделок <Дата N>

<Расчетный код 1>

Валюта лота			<Код валюты>						
Сопряж. валюта			<Код валюты>						
Номер сделки	Дата заключения сделки	Время заключения сделки	Инструмент	Тип сделки	Направление сделки	Объем в валюте лота (в единицах валюты)	Объем в сопряж. валюте	Курс	Код клиента
				К/П	<S>/				
				Своп	<S>/				
				БКТ	<S>/				
Итого покупка						<сумма>	<сумма>		
Итого продажа						<сумма>	<сумма>		

Валюта лота			<Код валюты>						
Сопряж. валюта			<Код валюты>						
Номер сделки	Дата заключения сделки	Время заключения сделки	Инструмент	Тип сделки	Направление сделки	Объем в валюте лота (в единицах валюты)	Объем в сопряж. валюте	Курс	Код клиента
				К/П	<S>/				
				Своп	<S>/				
				БКТ	<S>/				
Итого покупка						<сумма>	<сумма>		
Итого продажа						<сумма>	<сумма>		

...

«Расчетный код N»

Валюта лота			<Код валюты>						
Сопряж. валюта			<Код валюты>						
Номер сделки	Дата заключения сделки	Время заключения сделки	Инструмент	Тип сделки	Направление сделки	Объем в валюте лота (в единицах валюты)	Объем в сопряж. валюте	Курс	Код клиента
				К/П	<S>/				
				Своп	<S>/				
				БКТ	<S>/				
Итого покупка						<сумма>	<сумма>		
Итого продажа						<сумма>	<сумма>		

Валюта лота			<Код валюты>						
Сопряж. валюта			<Код валюты>						
Номер сделки	Дата заключения сделки	Время заключения сделки	Инструмент	Тип сделки	Направление сделки	Объем в валюте лота (в единицах валюты)	Объем в сопряж. валюте	Курс	Код клиента
				К/П	<S>/				
				Своп	<S>/				
				БКТ	<S>/				
Итого покупка						<сумма>	<сумма>		
Итого продажа						<сумма>	<сумма>		

Дата: _____
 Подпись _____ уполномоченного _____ лица _____ ЗАО _____ АКБ _____ «Национальный Клиринговый Центр»: _____/Ф.И.О

Приложение № 42

к Правилам осуществления клиринговой деятельности Акционерным
Коммерческим Банком «Национальный Клиринговый Центр» (Закрытое
акционерное общество) при проведении Единой торговой сессии

Документы, предоставляемые Организацией для заключения Договора об оказании клиринговых услуг

I. Документы, предоставляемые кредитной организацией, Государственной корпорацией, некредитной организацией

- 1) Анкета Участника клиринга (Регистрационная карточка), форма которой предусмотрена приложением 2 к Правилам клиринга, на бумажном носителе и в электронном виде.
- 2) Нотариально удостоверенная копия Свидетельства о внесении записи в ЕГРЮЛ, выданная уполномоченным органом исполнительной власти, осуществляющим государственную регистрацию юридических лиц, и подтверждающую факт внесения в ЕГРЮЛ записи о государственной регистрации юридического лица (либо о юридическом лице, зарегистрированном до 1 июля 2002 года).
- 3) Выписка из Единого государственного реестра юридических лиц (ЕГРЮЛ), действующая на дату предоставления документов и выданная регистрирующим органом не ранее 30-ти дней до дня предоставления выписки из Единого государственного реестра юридических лиц в Клиринговый центр, или нотариально удостоверенную копию такой выписки.
- 4) Нотариально удостоверенная копия свидетельства о постановке на учет в налоговом органе.
- 5) Нотариально удостоверенная копия информационного письма о присвоении кодов статистики или копия, заверенная подписью уполномоченного лица и печатью юридического лица.
- 6) Нотариально удостоверенные копии лицензий на право осуществления деятельности, подлежащей лицензированию (если имеются).
- 7) В отношении единоличного исполнительного органа (далее по тексту - руководитель):
 - подлинник или нотариально удостоверенная копия решения уполномоченного органа юридического лица (также могут быть предоставлены нотариально удостоверенная выписка из решения или подлинник выписки, заверенный подписью лица, уполномоченного на подписание решения) об избрании единоличного исполнительного органа;
 - копия документа, удостоверяющего личность, заверенная подписью уполномоченного лица и печатью юридического лица, или письмо юридического лица, содержащее сведения о реквизитах документа, удостоверяющего личность, а также о дате и месте рождения, адресе места жительства (регистрации) или места пребывания;
 - копия свидетельства о постановке на учет в налоговом органе (ИНН), заверенная подписью уполномоченного лица и печатью юридического лица, либо письмо в произвольной форме с указанием ИНН (при наличии).

- 8) В случае подписания Договора об оказании клиринговых услуг и (или) других документов в соответствии с настоящими Правилами клиринга от имени юридического лица не единоличным исполнительным органом, юридическое лицо предоставляет на такое уполномоченное лицо оригинал доверенности или нотариально удостоверенную копию, или копию доверенности, заверенную лицом, выдавшим указанную доверенность. В случае если доверенность представляет полномочия на совершение операций с денежными средствами или иным имуществом, дополнительно предоставляются:
- копия документа, удостоверяющего личность, заверенная подписью уполномоченного лица и печатью юридического лица, или письмо юридического лица, содержащее сведения о реквизитах документа, удостоверяющего личность, а также о дате и месте рождения, адресе места жительства (регистрации) или места пребывания;
 - копия свидетельства о постановке на учет в налоговом органе (ИНН), заверенная подписью уполномоченного лица и печатью юридического лица, либо письмо в произвольной форме с указанием ИНН (при наличии);
- 9) Нотариально удостоверенная копия карточки с образцами подписей и оттиска печати юридического лица.
- 10) Подлинник или нотариально удостоверенная копия решения уполномоченного органа юридического лица (также могут быть предоставлены нотариально удостоверенная выписка из решения или подлинник выписки, заверенный подписью лица, уполномоченного на подписание решения) об одобрении сделок, заключаемых в соответствии с Правилами клиринга с Клиринговым центром, а также Договора об оказании клиринговых услуг в случае, если сделки/договор между юридическим лицом и Клиринговым центром в соответствии с требованиями действующего законодательства признаются сделками с заинтересованностью, в противном случае юридическое лицо предоставляет письмо об отсутствии признаков заинтересованности в указанных сделках (договорах).
- 11) Согласие лиц, указанных в документах юридического лица, направляемых им в Клиринговый центр в соответствии с Правилами клиринга, на обработку персональных данных по форме, размещенной на Сайте Клирингового центра (в случае, если документы содержат персональные данные субъекта персональных данных в соответствии с Федеральным законом «О персональных данных» и если иное не вытекает из требований законодательства).
- 12) Иные документы, которые могут быть запрошены Клиринговым центром в необходимых случаях в целях, не противоречащих действующему законодательству Российской Федерации.
- 13) Если физическое лицо, на которое требуется предоставить копию документа, удостоверяющего личность, заверенную подписью уполномоченного лица и печатью юридического лица, является иностранным гражданином (лицом без гражданства), то дополнительно необходимо представить:
- заверенную печатью юридического лица и подписью уполномоченного лица копию документа, подтверждающего право иностранного гражданина (лица без гражданства) на пребывание (проживание) в Российской Федерации (вид на жительство, разрешение на временное проживание, виза, иной документ, подтверждающий в соответствии с законодательством

Российской Федерации право иностранного гражданина или лица без гражданства на пребывание (проживание) в Российской Федерации);

- заверенную печатью юридического лица и подписью уполномоченного лица юридического лица копию миграционной карты;
- письмо со сведениями об адресе места жительства (регистрации) или места пребывания (в случае пребывания (проживания) иностранного гражданина в Российской Федерации, и если такая информация не содержится в иных документах, представленных в соответствии с настоящим списком)

II. Документы, предоставляемые кредитной организацией

Кредитная организация помимо документов, указанных в разделе I настоящего приложения к Правилам клиринга, предоставляет:

- 1) Нотариально удостоверенные копии учредительных документов с изменениями и дополнениями и нотариально удостоверенные копии свидетельств о регистрации этих изменений.
- 2) Нотариально удостоверенную копию лицензии Банка России на осуществление банковских операций со средствами в рублях и иностранной валюте.
- 3) В отношении руководителя:
 - нотариально удостоверенная копия письма территориального учреждения Банка России с подтверждением согласования кандидатуры руководителя;
 - нотариально удостоверенную копию сообщения Банка России о принятии карточки с образцом подписи в случае, если решение уполномоченного органа кредитной организации об избрании/назначении нового единоличного исполнительного органа принято ранее даты согласования кандидатуры нового единоличного исполнительного органа.
- 4) Отчетность, указанную в пункте 1) приложения № 43 к Правилам клиринга, за исключением отчета о прибылях и убытках, за три последних отчетных месяца, а отчет о прибылях и убытках - на последнюю отчетную квартальную дату.

Указанная отчетность предоставляется на бумажном носителе и электронном виде или в форме электронного документа.

Документы, указанные в этом разделе, могут быть предоставлены в адрес Клирингового центра головным офисом или филиалом кредитной организации.

III. Документы, предоставляемые Государственной корпорацией

Государственная корпорация помимо документов, указанных в разделе I настоящего приложения к Правилам клиринга, предоставляет:

- 1) Копии документов, подтверждающие создание Государственной корпорации, предусмотренные законом.
- 2) В отношении руководителя:
 - копию нормативного документа о назначении единоличного исполнительного органа Государственной корпорации.
- 3) Отчетность, указанную в пункте 2) приложения № 43 к Правилам клиринга, за исключением отчета о прибылях и убытках, за три последних отчетных месяца, а

отчет о прибылях и убытках - на последнюю отчетную квартальную дату.

Указанная отчетность предоставляется на бумажном носителе и электронном виде или в форме электронного документа.

Документы, указанные в этом разделе, могут быть предоставлены в адрес Клирингового центра головным офисом или филиалом кредитной организации.

IV. Документы, предоставляемые некредитной организацией

Некредитная организация помимо документов, указанных в разделе I настоящего приложения к Правилам клиринга, предоставляет:

- 1) Копии учредительных документов юридического лица с изменениями и дополнениями с отметкой о регистрации федеральным органом исполнительной власти, уполномоченным на осуществление государственной регистрации юридических лиц. Указанные копии должны быть заверены федеральным органом исполнительной власти, уполномоченным на осуществление государственной регистрации юридических лиц, или нотариально.
- 2) Отчетность, указанную в пункте 3) приложения № 43 к Правилам клиринга, за два последних отчетных квартала.
Указанная отчетность предоставляется на бумажном носителе и электронном виде или в форме электронного документа.
Документы, указанные в этом разделе, могут быть предоставлены в адрес Клирингового центра головным офисом или филиалом кредитной организации.

V. Документы, предоставляемые Банком-нерезидентом

- 1) Анкета Участника клиринга (Регистрационная карточка), форма которой предусмотрена приложением 2 к Правилам клиринга, на бумажном носителе и в электронном виде.
- 2) Надлежащим образом оформленные документы (здесь и далее под надлежащим образом оформленными документами понимаются документы, которые должны быть переведены на государственный язык Российской Федерации (русский язык), и верность перевода и подлинность подписи переводчика должны быть нотариально удостоверены), подтверждающие правовой статус Банка-нерезидента по национальному законодательству государства его учреждения, в том числе, документы, подтверждающие государственную регистрацию Банка-нерезидента.
- 3) Надлежащим образом оформленные документы, подтверждающие постановку на учет или подтверждающие учет в налоговом органе Российской Федерации (в случае если в соответствии с законодательством Российской Федерации постановка на налоговый учет или учет является обязательными).
- 4) Надлежащим образом оформленное специальное разрешение (лицензия или иное основание) на осуществление банковских операций, выданное компетентным органом.
- 5) Надлежащим образом оформленное специальное разрешение (лицензия или иное основание), выданное уполномоченным органом государства учреждения Банка-нерезидента на право осуществления деятельности, осуществление которой в соответствии с национальным законодательством государства учреждения Банка-нерезидента возможно при наличии соответствующего специального разрешения

уполномоченного органа.

- 6) Надлежащим образом оформленные документы, подтверждающие прохождение кандидатом в руководители Банка-нерезидента установленные национальным законодательством государства учреждения Банка-нерезидента процедуры назначения, если назначение на соответствующие должности обусловлено прохождением установленных процедур.
- 7) Анкету физического лица (по форме приложения № 20 к Правилам клиринга) в отношении представителей Банка-нерезидента.
- 8) Опросную Анкету Банка-нерезидента (по форме приложения № 18 к Правилам клиринга).
- 9) Отчетность, указанную в пункте 5) приложения № 43 к Правилам клиринга, за исключением финансовой отчетности, за 3 (три) последние отчетные даты, а финансовую отчетность - за последний отчетный год.

Указанная отчетность предоставляется на бумажном носителе и электронном виде или в форме электронного документа.

VI. Документы, предоставляемые Международной организацией

- 1) Анкета Участника клиринга (Регистрационная карточка), форма которой предусмотрена приложением 2 к Правилам клиринга, на бумажном носителе и в электронном виде.
- 2) Копия международного договора.
- 3) Копия устава или иного аналогичного документа, подтверждающего статус Международной организации, с изменениями и дополнениями;
- 4) Нотариально удостоверенная копия свидетельства о постановке на учет в налоговом органе.
- 5) Нотариально удостоверенная копия карточки с образцами подписей и оттиска печати Международной организации.
- 6) Нотариально удостоверенная копия документов, подтверждающих полномочия единоличного исполнительного органа.
- 7) Нотариально удостоверенная копия информационного письма о присвоении кодов статистики или копию, заверенную подписью уполномоченного лица и печатью Организации.
- 8) Отчетность, указанную в пункте 2) приложения № 43 к Правилам клиринга, за исключением отчета о прибылях и убытках, за три последних отчетных месяца, а отчет о прибылях и убытках - на последнюю отчетную квартальную дату.

Указанная отчетность предоставляется на бумажном носителе и электронном виде или в форме электронного документа.

Документы, указанные в этом разделе, могут быть предоставлены в адрес Клирингового центра головным офисом или филиалом кредитной организации.

- 9) В отношении представителей Международной организации:
 - копия документа, удостоверяющего личность, заверенная подписью уполномоченного лица и печатью юридического лица, или письмо юридического лица, содержащее сведения о реквизитах документа,

удостоверяющего личность, а также о дате и месте рождения, адресе места жительства (регистрации) или места пребывания;

- копия свидетельства о постановке на учет в налоговом органе (ИНН), заверенная подписью уполномоченного лица и печатью юридического лица, либо письмо в произвольной форме с указанием ИНН (при наличии);

Если физическое лицо, на которое требуется предоставить копию документа, удостоверяющего личность, заверенную подписью уполномоченного лица и печатью юридического лица, является иностранным гражданином (лицом без гражданства), то дополнительно необходимо представить:

- О заверенную печатью юридического лица и подписью уполномоченного лица юридического лица копию документа, подтверждающего право иностранного гражданина (лица без гражданства) на пребывание (проживание) в Российской Федерации (вид на жительство, разрешение на временное проживание, виза, иной документ, подтверждающий в соответствии с законодательством Российской Федерации право иностранного гражданина или лица без гражданства на пребывание (проживание) в Российской Федерации);
- О заверенную печатью юридического лица и подписью уполномоченного лица юридического лица копию миграционной карты;
- О письмо со сведениями об адресе места жительства (регистрации) или места пребывания (в случае пребывания (проживания) иностранного гражданина в Российской Федерации, и если такая информация не содержится в иных документах, представленных в соответствии с настоящим списком).

При предоставлении документов, указанных в настоящем приложении к Правилам клиринга нерезидентами, указанные документы должны быть переведены на государственный язык Российской Федерации (русский язык), верность перевода и подлинность подписи переводчика должны быть нотариально удостоверены.

Требование о представлении документов с надлежащим образом заверенным переводом на русский язык не распространяется:

- на документы, удостоверяющие личности физических лиц, выданные компетентными органами иностранных государств, составленные на нескольких языках, включая русский;
- на документы, удостоверяющие личности физических лиц, выданные компетентными органами иностранных государств, при условии наличия у физического лица документа, подтверждающего право законного пребывания на территории Российской Федерации (например, въездная виза, миграционная карта).

Документы, предоставляемые Организацией, должны быть действительными на дату их предъявления Клиринговому центру.

В целях идентификации Организации и ее представителей - физических лиц и (или) выгодоприобретателей, Клиринговый центр при необходимости может запросить дополнительные документы (сведения), а также потребовать уточнения информации, содержащейся в ранее представленных документах.

Все предъявляемые документы должны быть действительны на дату их предъявления.

К предоставляемым документам прилагается сопроводительное письмо с описью направляемых Клиринговому центру документов, подготовленное с использованием надстройки MS EXCEL "Опись документов", размещенной на Сайте Клирингового центра).

Приложение № 43

к Правилам осуществления клиринговой деятельности Акционерным
Коммерческим Банком «Национальный Клиринговый Центр» (Закрытое
акционерное общество) при проведении Единой торговой сессии

**Отчетность, предоставляемая Участниками клиринга
Клиринговому центру**

- 1) Кредитные организации предоставляют Клиринговому центру:
 - оборотную ведомость по счетам бухгалтерского учета кредитной организации (форма 0409101) – ежемесячно;
 - информацию об обязательных нормативах и о других показателях деятельности кредитной организации (форма 0409135) – ежемесячно;
 - расчет собственных средств (капитала) (форма 0409134) – ежемесячно;
 - отчет о прибылях и убытках кредитной организации (форма 0409102) – ежеквартально;
 - справку о численном значении норматива максимального размера риска на одного заемщика или группу связанных заемщиков (Н6) (по данным формы 0409118) – ежемесячно;
 - квартальный отчет профессионального участника рынка ценных бумаг (форма №1100) – ежеквартально.
- 2) Государственные корпорации и Международные организации предоставляют Клиринговому центру:
 - оборотную ведомость по счетам бухгалтерского учета (форма 0409101) - ежемесячно;
 - отчет о прибылях и убытках (форма 0409102) - ежеквартально;
 - расчет собственных средств (капитала) (форма 0409134) – ежемесячно.
- 3) Некредитные организации предоставляют Клиринговому центру:
 - бухгалтерский баланс (форма 0710001) – ежеквартально;
 - отчет о прибылях и убытках (форма 0710002) – ежеквартально;
 - расчет размера собственных средств (капитала) для профессиональных участников рынка ценных бумаг – ежемесячно;
 - квартальный отчет профессионального участника рынка ценных бумаг (форма №1100) – ежеквартально.
- 4) Участники клиринга обязаны предоставлять отчетность, указанную в пунктах 1)-3) настоящего приложения к Правилам клиринга, в следующие сроки:
 - расчет размера собственных средств:
 - не позднее 15 рабочего дня месяца, следующего за отчетным месяцем (кредитными организациями, Государственными корпорациями и Международными организациями);
 - не позднее одного календарного месяца, следующего за отчетным месяцем (некредитными организациями);
 - оборотную ведомость по счетам бухгалтерского учета (форма 0409101) - не

позднее 15 рабочего дня месяца, следующего за отчетным месяцем;

- отчет о прибылях и убытках (форма 0409102) - не позднее 15 рабочего дня месяца, следующего за отчетным кварталом;
- бухгалтерский баланс некредитной организации (форма 0710001), отчет о прибылях и убытках некредитной организации (форма 0710002) - не позднее 45 (сорока пяти) календарных дней, следующих за отчетным кварталом, за исключением отчетности по состоянию на 1 января, которая предоставляется не позднее 15 апреля года, следующего за отчетным;
- информацию об обязательных нормативах и о других показателях деятельности кредитной организации (форма 0409135), справку о численном значении норматива максимального размера риска на одного заемщика или группу связанных заемщиков (Н6) кредитной организации (по данным формы 0409118) - не позднее 15 рабочего дня месяца, следующего за отчетным месяцем;
- квартальный отчет профессионального участника рынка ценных бумаг (форма №1100) - не позднее 45 (сорока пяти) календарных дней, следующих за отчетным кварталом, за исключением отчетности по состоянию на 01 января, которая предоставляется не позднее 15 апреля года, следующего за отчетным.

5) Банки-нерезиденты не позднее 15 (пятнадцати) рабочих дней с даты сдачи ежемесячной или квартальной отчетности соответственно или с даты, определенной компетентным органом государства учреждения Банка-нерезидента для сдачи ежемесячной или квартальной отчетности соответственно (в случае если сроки сдачи отчетности устанавливаются компетентным органом государства учреждения Банка-нерезидента), предоставляют Клиринговому центру следующие документы, составленные на русском или английском языке:

- финансовую отчетность по МСФО, а при ее отсутствии - отчетность по национальным стандартам бухгалтерского учета и отчетности, содержащую бухгалтерский баланс, отчет о прибылях и убытках, расчет собственных средств (капитала) Участника клиринга-нерезидента – ежеквартально;
- баланс в форме оборотной ведомости по счетам бухгалтерского учета по национальным стандартам государства учреждения Банка-нерезидента бухгалтерского учета и отчетности - ежемесячно;
- документ, содержащий информацию о финансовых показателях за отчетный месяц, данные о величине и структуре активов и обязательств, финансовых результатах деятельности, величине собственных средств (капитала), отраженных в отчетности Банка-нерезидента – ежемесячно (по форме приложения № 17 к Правилам клиринга);
- документ, подтверждающий сведения о фактических и допустимых значениях обязательных нормативов деятельности, установленных компетентным органом – ежемесячно (в случае если в соответствии с национальным законодательством государства учреждения Банка-нерезидента такие обязательные нормативы устанавливаются).

Банки-нерезиденты не позднее 15 (пятнадцати) рабочих дней с даты подписания отчетности организацией, проводившей аудит Банка – нерезидента, предоставляют Клиринговому центру:

- финансовую отчетность по МСФО на русском или английском языке за последний отчетный год, заверенную аудитором, а при ее отсутствии -

аудированную финансовую отчетность, составленную в соответствии с требованиями национального законодательства государства учреждения Банка-нерезидента. Указанная отчетность представляется, начиная с года, следующего за годом предоставления доступа Банку-нерезиденту к клиринговому обслуживанию – ежегодно.

- 6) Форматы предоставления отчетности, указанной в пунктах 1)-3), 5) настоящего приложения к Правилам клиринга, определены Порядком предоставления информации и отчетности.